FORMULARIO "RC" RELATIVO A LOS REQUERIMIENTOS DE CAPITALIZACIÓN DE LAS CASAS DE BOLSA

CONTENIDO

AYUDAS GENÉRICAS 6

I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN 6

II. DEFINICIONES 6

III. OBJETIVO DEL REQUERIMIENTO 7

IV. SECCIONES DEL FORMULARIO 7

V. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR 7

VI. COBERTURA DEL FORMULARIO 8

VII. CIFRAS A REPORTAR 8

VIII. METODOLOGÍAS DE CONFRONTAS 9

IX. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN 9

X. TRANSMISIONES QUE NO SE APEGUEN AL "TIEMPO Y FORMA", Y RETRANSMISIONES 9

ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES 10

A. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC04, RC05, RC07 y RC11. 10

B. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC06, RC08, RC09 y RC12 42

AYUDAS ESPECÍFICAS 47

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 01 47

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 02 72

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 03 78

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 04 98

Versión 1.2
Fecha del Documento 11 de diciembre de 2018

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 05 123
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 06 133
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 07 142
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 08 148
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 09 158
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 11 175
Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 12 190
VALIDACIONES DE PROCESO 198
i. Descarga de diagnósticos 198
ETAPA: VALIDACIONES DE FORMATO Y CONSISTENCIA BÁSICA (TÉCNICAS) 202
i. Objetivo de la validación 202
ii. Validaciones por sección. 202
A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección. 202
RC01 a RC09, RC11 y RC12 202
ETAPA: VALIDACIONES HISTÓRICAS 207
i. Objetivo de la validación 207
ii. Validaciones por sección. 207
RC01 207
RC02 207
RC03 208
RC04 208
RC05 208
RC06 209
RC07 209
RC08 209

RC09 210
RC11 210
RC12 210
ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DEL REGISTRO 211
i. Objetivo de la validación 211
ii. Validaciones por sección. 211
A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección. 211
RC01 211
RC02 211
RC03 211
RC04 211
RC05 212
RC06 212
RC07 212
RC08 212
RC09 212
RC11 213
RC12 213
ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DEL REGISTRO (ABC) 214
i. Objetivo de la validación 214
ii. Validaciones por sección. 214
ETAPA: VALIDACIONES ENTRE SECCIONES 365
i. Objetivo de la validación 365
ii. Validaciones entre secciones. 365
Tipo 1.- Mercado vs Crédito Contraparte 365
1.1 Reportos 365

1.2 Swaps 369
1.3 Forwards 372
1.3.1 Forwards de Compra 372
1.3.2 Forwards de Venta 378
1.4 Préstamos de Títulos de Deuda 384
Tipo 2.- Mercado vs Crédito Emisor 386
2.1 Títulos de Deuda 386
2.1.1 Activos Brutos 386
2.1.2 Pasivos Brutos 395
Tipo 3.- Mercado (ACTIVO) vs Crédito Créditos 403
3.1 Depósitos a la Vista y a Plazo 403
3.2 Acciones 404
Tipo 4.- Mercado (ACTIVO) vs Mercado (PASIVO) 405
4.1 Swaps 405
4.2 Futuros 407
4.2.1 Futuros de Compra 407
4.2.2 Futuros de Venta 410
4.3 Forwards 413
4.3.1 Forwards de Compra 413
4.3.2 Forwards de Venta 416
4.4 Reportos 419
4.5 Opciones 421
4.5.1 Opciones de Compra 421

4.5.2 Opciones de Venta 425
4.6 Compra y Venta de Divisas Fecha Valor 429
4.7 Compra y Venta de Títulos de Deuda Fecha Valor 430
4.8 Compra y Venta de Acciones Fecha Valor 431
Tipo 5.- Crédito (RC09) vs Crédito (RC08) 432
5.1 Cargos Diferidos 432
Tipo 6.- Mercado vs Crédito Contraparte 432
6.1 Total de Operaciones de Reporto, Swaps, Forwards y Préstamos 432
ETAPA: VALIDACIONES POSTERIORES AL CÁLCULO 443
i. Objetivo de la validación 443
ii. Validaciones por sección. 443
RC09 443

AYUDAS GENÉRICAS

I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN

Circular 115/2002 numeral CB.8

Información al Banco de México.

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

Artículo 167 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa, de la CNBV

"Las casas de bolsa deberán proporcionar a la Comisión la información que sobre el particular les requiera —para determinar el cumplimiento de los requerimientos de capitalización—, en la forma y plazos que al efecto establezca la propia Comisión, la cual, en su caso, tendrá que reportarse debidamente valuada".

II. DEFINICIONES

Para efectos de estos formularios se entenderá como:

- **Alto Grado de Inversión**, al grado de calificación indicado en la fracción I del Artículo 148 de las Disposiciones.
- **Categoría de Calificación**, a la categoría de calificación indicada en la fracción II del Artículo 148 de las Disposiciones.
- **Grado de Inversión**, al grado de calificación indicado en la fracción III del Artículo 148 de las Disposiciones.
- **Comisión**, a la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.
- **Disposiciones**, a las disposiciones para los requerimientos de capitalización de las Casas de Bolsa, contenidas en la Sección Segunda del Capítulo Cuarto de la Circular Única de Casas de Bolsa publicadas por la Comisión en el Diario Oficial de la Federación del 29 de marzo de 2006.
- **Instituciones**, a las instituciones de banca múltiple, a las instituciones de banca de desarrollo, a las casas de bolsa y a las sociedades financieras de objeto limitado en las que tenga control directa o indirectamente una sociedad controladora de un grupo financiero en el que participe una institución de banca múltiple o bien que tenga vínculos patrimoniales con una institución de banca múltiple.
- **Valor contable o valor razonable**, al que se determine conforme a la fracción III del Artículo 149 de las Disposiciones.

III. OBJETIVO DEL REQUERIMIENTO

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información relativa al Cómputo de Capitalización y al Índice de Capitalización.

IV. SECCIONES DEL FORMULARIO

- RC01 Relativa a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Nominal en Moneda Nacional.
- 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.
- RC03 Relativa a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Real en Udis y en Moneda Nacional.
- RC04 Relativa a Operaciones con Riesgo de Mercado por Tasa de Interés Nominal en Moneda Extranjera.
- RC05 Relativa al Riesgo de Mercado por Operaciones con Acciones y Sobre Acciones o con Rendimiento Referido a éstas.
- RC06 Relativa al Riesgo de Crédito (Contraparte) en Operaciones de Reporto y de Derivados.
- RC07 Relativa al Riesgo de Crédito (Emisor) por Posiciones en Títulos de Deuda.
- RC08 Relativa al Riesgo de Crédito por Depósitos, Préstamos, Créditos, Otros Activos y Operaciones Contingentes.
- RC09 Relativa a La Integración del Capital Neto.
- RC11 Relativa 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 Relativa al Riesgo Operacional.

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 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, el 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 (Entidad Financiera Filial), y iii) el Fondo de Reserva para Pensiones, Jubilaciones y demás Prestaciones al Personal de la propia Institución (Fondo de Reserva del Personal), cuando la Institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dicho Fondo.

Debe transmitirse un formulario (con sus once secciones) por cada Entidad Financiera del Exterior Filial, 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 ésta o como un consentimiento o convalidación o autorización de la autoridad para realizar tales operaciones o para realizarlas en términos y condiciones que no se ajusten a las disposiciones aplicables.

VII. CIFRAS A REPORTAR

En cada una de las secciones se debe reportar la suma de las operaciones (o la parte de ellas) 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.

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 se realicen retransmisiones de información, la Institución deberá manifestar a este Instituto Central las causas que originaron tal situación y precisar, en el segundo caso, las modificaciones a las cifras, mediante comunicación por escrito que dirijan a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México.

Contenido

ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES

A. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC01, RC02, RC03, RC04, RC05, RC07 y RC11.

	Campo	Tipo	Descripción
1	Inst	Carácter (6)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".
2	Fecha	Fecha (8)	Fecha a la que corresponde la información.
3	Concepto	Carácter (6)	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".
4	Importe 1	Numérico (12,3)	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.
5	Importe 2	Numérico (12,3)	Importe de las operaciones "indirectas" de la Institución por su inversión en sociedades y fondos de inversión.

CONTENIDO DE LAS SECCIONES DEL FORMULARIO

Cada uno de los conceptos de las secciones RC01, RC02, RC03, RC04 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

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC01.

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Depósitos bancarios a la vista.
- Depósitos bancarios a plazo.
- Moneda nacional a recibir por venta de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda nacional a recibir por venta de acciones (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda nacional a recibir por venta de títulos de deuda (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda nacional a recibir por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por compra de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a recibir por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Tenencia de títulos.
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestamista.
- Moneda nacional a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de compra de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.

- Moneda nacional a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas.
- Moneda nacional a recibir (fase activa) por futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés nominal, bonos a tasa de fija y divisas (fase activa).
- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal (fase activa), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal (fase activa), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal (fase activa), a los que se refiere Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal (fase activa), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal fija (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal variable (fase activa).
- Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.
- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.
- Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.
- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.
- Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.

- Moneda nacional a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).

- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).

- Operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional.

- Futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase activa).

- Futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase activa).

- Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase activa).

- Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase activa).

- Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa).

- Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa).

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Moneda nacional a entregar por compra de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).

- Instrumentos de captación a plazo.

- Préstamos y depósitos de bancos.

- Moneda nacional a entregar por compras de títulos de deuda (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).

- Moneda nacional a entregar por compras de acciones (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).

- Moneda nacional a entregar por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por venta de títulos (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a entregar por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestatario.
- Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Moneda nacional a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda nacional a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas.
- Moneda nacional a entregar (fase pasiva) por futuros de compra de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).
- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).

- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés nominal fija (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés nominal variable (fase pasiva).
- Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasas de interés nominal.
- Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasas de interés nominal.
- Moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.
- Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.
- Moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Subyacente a entregar, por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.
- Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.
- Moneda nacional a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB.
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Operaciones pasivas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional.
- Futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva).
- Futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva).
- Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).

Operaciones Activas que se Compensan Totalmente

- Moneda nacional a recibir por venta de divisas y de títulos de deuda, así como por reportos actuando como reportado (únicamente operaciones fecha valor pendientes de liquidar).
- Moneda nacional a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia de títulos; que se hayan compensado con otras operaciones con títulos.
- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta de tasas de interés nominal, y/o "swaps en los que se entregue una tasa de interés nominal fija, así como otros derivados sobre títulos a tasa fija.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés nominal (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda nacional a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).

- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés nominal (fase activa); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.

- Paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés (fase activa); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta de tasa de interés, o con "swaps", en los que se entregue una tasa de interés fija.

- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés nominal (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase activa) compensados con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase pasiva).

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal fija (fase activa), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.

- "Swaps" en los que se recibe una tasa de interés fija (fase activa), que se hayan compensado con "swaps" en los que se entregue una tasa de interés fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés.

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal variable (fase activa) compensadas con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés nominal variable (fase pasiva).

- Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal, compensada con moneda nacional a entregar por tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal.

- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal compensada con moneda nacional a entregar por emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal.

- Subyacente a recibir, por emisión de opciones de venta de tasa de interés nominal, compensada con moneda nacional a entregar por tenencia de opciones de venta de tasa de interés nominal.

- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones de compra de tasa de interés nominal, compensada con moneda nacional a entregar por emisión de opciones de compra de tasa de interés nominal.

- Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones de compra de divisas, compensada con moneda nacional a entregar por tenencia de opciones de compra de divisas.

- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones de venta de divisas, compensada con moneda nacional a entregar por emisión de opciones de venta de divisas.

- Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda nacional a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda nacional a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.

- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.

- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art. 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).

- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se el Art. 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).

- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa) compensados con títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).

- Moneda nacional a recibir por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa) compensada con moneda nacional a entregar por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).

- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa) compensados con títulos a entregar por operaciones con títulos de deuda a tasa fija (fase pasiva).

- Futuros de compra de swaps relativos a una tasa de interés nominal (fase activa), compensados con futuros de venta de swaps, relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva).

- Futuros de venta de swaps relativos a una tasa de interés nominal (fase activa), compensados con futuros de compra de swaps, relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva).

Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

- Moneda nacional a entregar por compra de divisas y de títulos de deuda, así como por reportos actuando como reportador (únicamente operaciones fecha valor pendientes de liquidar).

- Moneda nacional a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportado.

- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos, que se hayan compensado con otras operaciones con títulos.

- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra sobre tasas de interés y/o "swaps" sobre tasa de interés fija, así como otros derivados sobre títulos a tasa fija.

- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.

- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.

- Moneda nacional a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de divisas.

- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).

- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).

- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés nominal (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.

- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.

- Paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés (fase pasiva); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra de tasa de interés, o con "swaps", en los que se recibe una tasa de interés fija.

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase pasiva) que se compensen con operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés nominal (fase activa).

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés nominal fija (fase pasiva), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.

- "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés fija (fase pasiva), que se hayan compensado con "swaps" en los que se recibe una tasa de interés fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés.

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés nominal variable (fase pasiva) que se compensen con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés nominal variable (fase activa).

- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasas de interés nominal, compensada con subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasas de interés nominal, compensada con subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.

- Moneda nacional a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal, compensada con moneda nacional a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.

- Moneda nacional a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal, compensado con moneda nacional recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

- Moneda nacional a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas, compensada con moneda nacional a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

- Moneda nacional a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas, compensada con moneda nacional a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

- Subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Moneda nacional a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda nacional a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Moneda nacional a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda nacional a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).

- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).

- Moneda nacional a entregar por futuros y forwards de compra de bonos de tasa fija (fase pasiva) compensada con moneda nacional a recibir por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa).

- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos de tasa fija (fase pasiva) compensados con títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa).

- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos de tasa fija (fase pasiva) compensados con títulos a recibir por operaciones con títulos de deuda a tasa fija (fase activa).

- Futuros de compra de swaps relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva), compensados con futuros de venta de swaps, relativos a una tasa de interés nominal (fase activa).

- Futuros de venta de swaps relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva), compensados con futuros de compra de swaps, relativos a una tasa de interés nominal (fase activa).

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC02.

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Títulos de deuda a recibir por compra de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a recibir por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Tenencia de títulos.
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestamista.
- Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Otras operaciones activas con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa.

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Títulos de deuda a entregar por venta de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendiente de liquidar).
- Títulos a entregar por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestatario.
- Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Otras operaciones pasivas con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa.

Operaciones que se Compensan Totalmente

- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos, préstamos u otras operaciones, así como tenencia de títulos.
- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos, préstamos u otras operaciones.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC03.

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Depósitos bancarios a plazo.
- Títulos de deuda a recibir por compra de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a recibir por reportos actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48,72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Tenencia de títulos.
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestamista.
- Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés reales en moneda nacional (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés reales en moneda nacional (fase activa).
- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional (fase activa).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional (fase activa).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés reales en moneda nacional (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés real fija en moneda nacional (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase activa).

- UDIS a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Otras operaciones activas en UDIS o que sean objeto de una tasa de interés real en moneda nacional.
- Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase activa)
- Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa).

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Instrumento de captación a plazo.
- Préstamos y depósitos de bancos.
- Títulos de deuda a entregar por venta de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a entregar por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos actuando como prestatario.
- Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB

- Futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional (fase pasiva).
- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés reales en moneda nacional (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés real fija en moneda nacional (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase pasiva).
- Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.

- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art. 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art. 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Otras operaciones pasivas en UDIS o que sean objeto de una tasa de interés real en moneda nacional.
- Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).

Operaciones Activas que se Compensan Totalmente

- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia de títulos; que se hayan compensado con otras operaciones con títulos.
- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta, y/o "swaps" sobre tasa de interés, así como otros derivados sobre títulos.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional y bonos a tasa fija (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional y bonos a tasa fija (fase activa).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés real (fase activa); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- Paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés real (fase activa); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta de tasa de interés real, o con "swaps", en los que se entregue una tasa real fija.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional y bono a tasa fija (fase activa) compensados con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional y bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés real fija en moneda nacional (fase activa), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- "Swaps" en los que se recibe una tasa real fija (fase activa), que se hayan compensado con "swaps" en los que se entregue una tasa real fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés real.

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase activa) compensadas con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase pasiva).
- UDIS a recibir por emisión de opciones de compra de tasa de interés real, compensada con UDIS a entregar por tenencia de opciones de compra a tasa de interés real.
- UDIS a recibir por tenencia de opciones de venta de tasa de interés real en moneda nacional; compensada con UDIS a entregar por emisión de opciones de venta de tasas de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones de venta de tasa de interés real en moneda nacional compensado con subyacente a entregar por tenencia de opciones de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones de compra de tasa de interés real en moneda nacional compensado con subyacente a entregar por emisión de opciones de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensada con UDIS a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensada con UDIS a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasas de interés real, compensada con subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasas de interés real, compensada con subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos en UDIS a tasa fija (fase activa), compensados con títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos en UDIS a tasa fija (fase pasiva).
- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos en UDIS a tasa fija (fase activa), compensados con títulos a entregar por operaciones con títulos de deuda en UDIS a tasa fija (fase pasiva).

Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos, que se hayan compensado con otras operaciones con títulos.

- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra, y/o "swaps" sobre tasa de interés, así como otros derivados sobre títulos.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional y bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real en moneda nacional y bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés real en moneda nacional (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés real (fase pasiva); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- Paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés real (fase pasiva); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra de tasa de interés real, o con swaps, en los que se reciba una tasa fija.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional (fase pasiva) que se compensen con operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas as subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda nacional (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés real fija en moneda nacional (fase pasiva), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- "Swaps" en los que se entregue una tasa real fija (fase pasiva), que se hayan compensado con "swaps" en los que se recibe una tasa real fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés real.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase pasiva) que se compensen con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés real variable en moneda nacional (fase activa).
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda nacional, compensada con subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional, compensada con UDIS a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en moneda nacional.
- UDIS a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional, compensada con UDIS a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en moneda nacional.

- Subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensado con subyacente a recibir pro emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensada con UDIS a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- UDIS a entregar, por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real, compensada con UDIS a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real.
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB. (parte relativa al contrato principal).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB. (parte relativa a instrumentos derivados).
- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos en UDIS a tasa fija (fase pasiva), compensados con títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos en UDIS a tasa fija (fase activa).
- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos en UDIS a tasa fija (fase pasiva), compensados con títulos a recibir por operaciones con títulos de deuda a tasa fija (fase activa).

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC04.

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Depósitos a la vista.
- Depósitos a plazo.
- Moneda extranjera a recibir por compras de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a recibir por ventas de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a recibir por ventas de títulos de deuda (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a recibir por ventas de acciones (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a recibir por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por compra de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a recibir por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).

- Tenencia de títulos.
- Títulos de deuda a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestamista.
- Moneda extranjera a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por futuros de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera y divisas (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera y divisas (fase activa).
- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera y divisas (fase activa).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera y divisas (fase activa).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés fija en moneda extranjera (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés variable en moneda extranjera (fase activa).
- Moneda extranjera a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.

- Moneda extranjera a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasas de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasas de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda extranjera.
- Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase activa).
- Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase activa).
- Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa).
- Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa).

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Moneda extranjera a entregar por compra de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a entregar por venta de divisas (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Instrumentos de captación a plazo.
- Préstamos y depósitos de bancos.
- Moneda extranjera a entregar por compras de títulos de deuda (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a entregar por compras de acciones (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a entregar por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por venta de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a entregar por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos de deuda a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestatario.
- Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Moneda extranjera a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por futuros de compra de divisas.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera y divisas (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera y divisas (fase pasiva).

- Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera y divisas (fase pasiva).
- Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera y divisas (fase pasiva).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Paquetes de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés fija en moneda extranjera (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés variable en moneda extranjera (fase pasiva).
- Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).

- Otras operaciones pasivas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda extranjera.
- Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).

Operaciones Activas que se Compensan Totalmente

- Moneda extranjera a recibir por venta de divisas y de títulos de deuda, así como por reportos actuando como reportado (únicamente operaciones fecha valor pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia de títulos; compensados con operaciones con títulos.
- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta y/o "swaps" sobre tasa de interés, así como otros derivados sobre títulos.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir (fase activa) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (fase activa).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- Paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés (fase activa); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de venta de tasa de interés, o con "swaps", en los que se entregue una tasa de interés fija.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase activa), a los que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda extranjera y bonos a tasa fija (fase activa), compensados con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés real en moneda extranjera, y bonos a tasa fina (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés fija en moneda extranjera (fase activa), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.

- "Swaps" en los que se recibe una tasa de interés fija (fase activa), que se hayan compensado con "swaps" en los que se entregue una tasa de interés fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se recibe una tasa de interés variable en moneda extranjera (fase activa) compensadas con otras operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entrega una tasa de interés nominal variable en moneda extranjera (fase pasiva).
- Moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera, compensada con moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera, compensada por moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera, compensado con subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera, compensado con subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas, compensada con moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas, compensada con moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas, compensado con subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas, compensado con subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).

- Posición activa en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa), compensados con títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Moneda extranjera a recibir por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa), compensados con moneda extranjera a entregar por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva).
- Títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa), así como operaciones con título de deuda compensados con títulos a entregar por operaciones con títulos de deuda a tasa fija (fase pasiva).

Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

- Moneda extranjera a entregar por compra de divisas y de títulos de deuda, así como por reportos actuando como reportador (únicamente operaciones fecha valor pendientes de liquidar).
- Moneda extranjera a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra, y/o "swaps" sobre tasa de interés, así como otros derivados sobre títulos.
- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o prestamos; compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra de tasa de interés, o con "swaps", en los que se recibe una tasa de interés fija.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva), distintos a los paquetes a que se refiere el Art 151 Fracción VIII de la CUB.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de divisas.
- Moneda extranjera a entregar (fase pasiva) por contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (fase pasiva).
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera (fase pasiva.
- Paquetes de contratos adelantados ("forwards") y de futuros de venta de tasa de interés nominal (fase pasiva); que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- Paquetes de "forwards" y de futuros de venta de tasa de interés (fase pasiva); compensados con paquetes de "forwards" y futuros de compra de tasa de interés, o con "swaps", en los que se recibe una tasa de interés fija.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes distintos a tasas de interés en moneda extranjera (fase pasiva).

- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera (fase pasiva), que se hayan compensado con operaciones con títulos de deuda a tasa fija.
- "Swaps" en los que se entregue una tasa de interés fija (fase pasiva), que se hayan compensado con "swaps" en los que se recibe una tasa de interés fija, o con paquetes de "forwards" y de futuros de compra de tasa de interés.
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) en las que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera (fase pasiva).
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera, compensado con subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera, compensada con moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en moneda extranjera.
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera, compensada con moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en moneda extranjera.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas, compensado con subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas, compensada con moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas, compensada con moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a recibir por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensado con subyacente a recibir por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a entregar por emisión de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda extranjera a recibir por tenencia de opciones y warrants de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Moneda extranjera a entregar por tenencia de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas, compensada con moneda extranjera a recibir por emisión de opciones y warrants de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.
- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art de 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa al contrato principal).

- Posición pasiva en operaciones estructuradas a las que se refiere el Art de 151 Fracción IX de la CUB (parte relativa a instrumentos derivados).
- Moneda extranjera a entregar por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva), compensados con moneda extranjera a recibir por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa).
- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva), compensados con títulos a recibir por futuros y forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa).
- Títulos a entregar por futuros y forwards de venta de bonos (fase pasiva), compensados con títulos a recibir por operaciones con títulos de deuda a tasa fija (fase activa).

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC05.

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Acciones a recibir, por compras y otras operaciones pendientes de liquidar.
- Tenencia de acciones.
- Inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas.
- Inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas y no cotizadas.
- Préstamo, actuando como prestatario (pendientes de liquidar).
- Préstamo, actuando como prestamista.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra.
- Futuros de compra.
- Emisión de opciones y títulos opcionales de venta.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales de compra.
- Swaps, subyacente accionario a recibir.
- Tenencia de títulos de deuda con rendimiento referido al de una acción.
- Tenencia de opciones sobre futuros de compra de una acción.
- Acciones a recibir por garantías otorgadas con transferencia de propiedad.
- Operaciones activas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados.
- Otras operaciones activas.

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Acciones a entregar, por ventas y otras operaciones pendientes de liquidar.
- Préstamo, actuando como prestamista (pendientes de liquidar).
- Préstamo, actuando como prestatario.
- Contratos adelantados ("forwards") de venta.
- Futuros de venta, de una acción.
- Emisión de opciones y títulos opcionales de compra.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales de venta.

- Swaps, subyacente accionario a entregar.
- Emisión de títulos de deuda con rendimiento referido al de una acción.
- Tenencia de opciones sobre futuros de venta.
- Acciones a entregar por garantías recibidas con transferencia de propiedad.
- Operaciones pasivas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados.
- Otras operaciones pasivas.

Conceptos para determinar requerimientos

- Suma de los montos que se compensan al determinar la posición neta de cada serie accionaria.
- Posición total larga.
- Posición total corta.
- Posición neta del portafolio (positiva).
- Posición neta del portafolio (negativa).

Conceptos informativos

- Suma de los montos de certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados.
- Posición total larga del portafolio certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados.
- Posición total larga del portafolio certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados.

Operaciones con metales preciosos

- Posición neta larga en oro.
- Posición neta larga en plata.
- Posición neta cota en oro.
- Posición neta corta en plata.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC07

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

1.- El grupo al que pertenece el Emisor del Título de Deuda:

- Grupo I
- Grupo II
- Grupo III

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 denominación o tasa de rendimiento del título de deuda:

- En moneda nacional con tasa de rendimiento nominal.
- En unidades de inversión (UDIS), o en moneda nacional con tasa de rendimiento real, o con tasa referida al Salario Mínimo General.
- En moneda extranjera.
- Con otro rendimiento (por ejemplo: referido al de una acción, una canasta de acciones o índices accionarios; referido a la variación de un tipo de cambio, etc.).
- Relativos a las inversiones del fondo de reserva del personal.
- Emitidos por instituciones de Banca Múltiple que no revelen su riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores.
- Con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios de desarrollo e indizados.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC11

Importe Bruto de las Operaciones Activas

- Valores a recibir por compra de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Valores a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestatario (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a recibir por reportos, actuando como reportador (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Tenencia de títulos.
- Valores a recibir por préstamo de títulos, actuando como prestamista.
- Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes referidos al S.M.G (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos al S.M.G (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- S.M.G a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G.
- S.M.G. a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Subyacente a recibir por emisiones de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos a S.M.G. (fase activa).
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referido al S.M.G. (fase activa).

- Posición activa en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX del Art 151 de las Disposiciones (parte relativa al contrato principal).
- Posición activa en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX del Art 151 de las Disposiciones (parte relativa a instrumentos derivados).
- Otros financiamientos otorgados y demás operaciones activas en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al S.M.G.

Importe Bruto de las Operaciones Pasivas

- Préstamos y depósitos de bancos.
- Valores a entregar por venta de títulos (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Valores a entregar por préstamo de títulos, actuando como prestamista (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Títulos a entregar por reportos, actuando como reportado (operaciones fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas, pendientes de liquidar).
- Valores a entregar por préstamo de títulos actuando como prestatario.
- Títulos a entregar por operaciones de reporto, actuando como reportador.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva)
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- S.M.G. a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- S.M.G. a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G (fase pasiva).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la Fracción IX del Art 151 de las Disposiciones (parte relativa al contrato principal).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la Fracción IX del Art 151 de las Disposiciones (parte relativa a instrumentos derivados).
- Otros financiamientos otorgados y demás operaciones pasivas en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al S.M.G.

Operaciones Activas que se Compensan Totalmente

- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia de títulos; que se hayan compensado con otras operaciones con títulos en moneda nacional referidos al S.M.G.

- Títulos a recibir por compras fecha valor, reportos o préstamos, así como tenencia; compensados con derivados sobre títulos en moneda nacional referidos al S.M.G.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes referidos al S.M.G.
- S.M.G. a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- S.M.G. a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase activa).
- Posición activa en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX de las disposiciones (parte relativa al contrato principal).
- Posición activa en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX de las disposiciones (parte relativa a instrumentos derivados).

Operaciones Pasivas que se Compensan Totalmente

- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos que se hayan compensado con otras operaciones con títulos en moneda nacional referidos con S.M.G.
- Títulos a entregar por ventas fecha valor, reportos o préstamos compensados con derivados sobre títulos en moneda nacional referidos al S.M.G.
- Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativas a subyacentes referidos al S.M.G.
- Subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos de opciones de compra de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).
- Subyacente a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G, compensado con emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. (fase pasiva).

- S.M.G. a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G (fase pasiva).
- S.M.G. a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G., compensado con emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G (fase pasiva).
- Posición activa en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX de las disposiciones (parte relativa al contrato principal).
- Posición pasiva en operaciones estructuradas, relativas a subyacentes referidos a S.M.G. a las que se refiere la fracción IX de las disposiciones (parte relativa a instrumentos derivados).

Contenido

B. ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES RC06, RC08, RC09 y RC12

	Campo	Tipo	Descripción
1	Inst	Carácter (6)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al "Catálogo de Instituciones".
2	Fecha	Fecha (8)	Fecha a la que corresponde la información.
3	Concepto	Carácter (6)	Clave del concepto a que corresponde la información, conforme al "Catálogo de Conceptos".
4	Importe 1	Numérico (12,3)	Importe de las operaciones de la Institución en la República Mexicana y/o sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.
5	Importe 2	Numérico (12,3)	No aplica. Debe informarse en ceros.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC06

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

1.- El grupo al que pertenece la contraparte:

- Grupo RC-I
- Grupo RC-II
- Grupo RC-III

2.- La clasificación de las operaciones de acuerdo al signo que resulte de restar al importe del activo, el importe del pasivo de cada operación:

- Operaciones sin importe positivo a favor de la institución.
- Operaciones con importe positivo a favor de la institución.
- Importe Positivo.

3.- El importe del activo, del pasivo; de las garantías reales aplicando el Método Simple y; el de las garantías reales aplicando el Método Integral, de las siguientes operaciones:

- Operaciones de reporto actuando como reportador.
- Operaciones de reporto actuando como reportado.
- Intercambios de flujos de dinero (swaps).
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de divisas.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de compra de tasas de interés.
- Contratos adelantados ("forwards") y futuros de venta de tasas de interés.
- "Forwards" y futuros de compra de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.
- "Forwards" y futuros de venta de subyacentes distintos a tasas de interés y divisas.
- Préstamos de valores actuando como prestamista.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales (warrants) de compra.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales (warrants) de venta.
- Operaciones de reporto y derivadas realizadas por parte del fondo de reserva de la institución.
- Operaciones con Instituciones de Banca Múltiple que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores.
- Préstamos de valores actuando como prestatario.
- Compraventa al contado de divisas y títulos.
- Intercambio de flujos de dinero (swaps), que se liquiden en cámaras de compensación.
- Contratos adelantados (“forwards”) y futuros de compra de divisas, que se liquiden con cámaras de compensación.
- Contratos adelantados (“forwards”) y futuros de venta de divisas, que se liquiden con cámaras de compensación.
- Contratos adelantados (“forwards”) y futuros de compra de tasas de interés, que se liquiden con cámaras de compensación.
- Contratos adelantados (“forwards”) y futuros de venta de tasas de interés, que se liquiden con cámaras de compensación.
- “Forwards” y futuros de compra de subyacente distintos a tasas de interés y divisas, que se liquiden con cámaras de compensación.
- “Forwards” y futuros de venta de subyacente distintos a tasas de interés y divisas, que se liquiden con cámaras de compensación.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales (warrants) de compra, que se liquiden con cámaras de compensación.
- Tenencia de opciones y títulos opcionales (warrants) de venta, que se liquiden con cámaras de compensación.

4.- Tratándose de operaciones derivadas, se debe clasificar considerando el mecanismo de liquidación de las operaciones, es decir, deberán separar las operaciones celebradas en mercados reconocidos y no reconocidos.

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 y otros activos.

- Caja, metales, documentos de cobro inmediato y remesas.

- Depósitos en bancos y en su caso créditos con sus intereses devengados a cargo de los grupos:

  Grupo RC -1

  Grupo RC -2

  Grupo RC -3

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

- Inversiones del fondo de reservas para pensiones del personal.

- Inversiones accionarias permanentes y del fondo de pensiones.

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 contable.
- Emisiones de obligaciones subordinadas (instrumentos de capitalización).
- Inversiones en obligaciones subordinadas, instrumentos relativos a esquemas de bursatilización y acciones.
- Reservas.
- Impuestos diferidos activos.
- 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.

CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12

Saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de los ingresos por comisiones y tarifas:

- Compra Venta de Valores.

- Actividades Fiduciarias.

- Custodia o Administración de Bienes.

- Ofertas Públicas.
- Operaciones con Oro y Plata.
- Intermediación Financiera.
- Operaciones con Sociedades de Inversión.
- Otras comisiones y Tarifas.
- Ingresos por Asesoría Financiera.

Saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de los gastos por comisiones y tarifas:

- Compra Venta de Valores.
- Transferencia de Fondos.
- Préstamos Recibidos.
- Colocación de Deuda.
- La Bolsa Mexicana de Valores.
- Intermediarios Financieros.
- El Indeval.
- Otras Comisiones y Tarifas.

Saldo acumulado al día último del mes inmediato anterior al mes del cómputo de las utilidades y pérdidas por compraventa:

- Valores e Instrumentos derivados.
- Utilidad por la venta de títulos.
- Pérdida por la venta de títulos.
- Divisas
- Metales
-

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 y rendimientos a favor provenientes de inversiones en valores.
- Intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto
- Premios a favor en operaciones de préstamos de valores.

- Prima por colocación de deuda.
- Cuenta de ajuste para cuenta de gastos por intereses con saldos negativos.
- Dividendos de Instrumentos de patrimonio neto.

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

- Intereses por pasivos bursátiles.
- Intereses por préstamos bancarios y otros organismos.
- Intereses por obligaciones subordinadas.
- Intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto.
- Premios a cargo en operaciones de préstamos de valores.
- Descuento por colocación de deuda.
- Cuenta de ajuste para cuenta de ingresos por intereses con saldos negativos.
- Gastos de Emisión por colocación de Deuda.
-

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

- Monto de la Cobertura de Seguros Relativos a Eventos Operacionales
- Reservas Constituidas por Riesgo Operacional

AYUDAS ESPECÍFICAS

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 01

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC01 RELATIVA A LAS 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; bienes en garantía (con transferencia de propiedad) y otras operaciones activas y pasivas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC01

La sección RC01 está conformada por los conceptos 10000 al 19256, con dos columnas en donde deberá reportar, 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 "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 y otras figuras similares, 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 reportar considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, con tasa de interés en moneda nacional que formen parte del portafolio de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción X del Art. 151 de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC01

En esta sección se solicita la suma 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 reportar con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportar con cifras al día último del mes de que se trate o a la fecha que la CNBV solicite la información conforme lo establece el art. 169 de la CUCB, en miles de pesos.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la CUCB, 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
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

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.

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 (el Art. 152, fracción I de la CUCB) 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.

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.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con cupones a tasa fija e instrumentos derivados que generen posiciones equivalentes a títulos a tasa fija, el plazo del instrumento, 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 2 de la CUCB.

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 haya más revisiones o ajustes de tasa posteriores.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, 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.

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 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.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC01

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

- La primera (del concepto 10000 al 15024), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportar 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 CUCB sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 16145 al 19256), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportar exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos del Art. 152, fracción II de la CUCB y lo señalado en la instrucción VII siguiente:

VII. COMPENSACIÓN DE OPERACIONES

En la segunda subsección a que se refiere la "instrucción VI", deberán reportar exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en la fracción II del Artículo 152 de la CUCB, que a la letra establece:

"*Fracción II del Artículo 152 de la CUCB)* 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 *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 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 Art. 151, frac. VII, 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 al *frac. VII del Art. 151*, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en la *frac. VIII del Art. 151* 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:

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 *frac. I del Art. 152*

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 sea igual o mayor a 365 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) En el caso de títulos de deuda dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza.

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).

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.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

Tratándose de opciones o títulos opcionales, se considerará como "valor delta", al resultado de multiplicar el valor de los títulos o instrumentos subyacentes que conforme al criterio que en materia contable establezca la CUB, por el número de títulos o instrumentos subyacentes que ampare la opción por la "delta" de la opción. La "delta" será, para el caso de opciones listadas, la que publique el mercado en donde éstas se coticen y para el caso de que no sea publicada o que se trate de opciones no listadas, la "delta" a utilizar será la que determine la propia casa de bolsa en su modelo de valuación.

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.

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 incluir las disponibilidades distintas de depósitos bancarios a plazo. A discreción de la Casa de Bolsa, en este concepto podrá incluir el saldo de caja.

Conceptos 10100 – 10126: Depósitos bancarios a plazo

En estos conceptos deben incluir, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Concepto 10195: Moneda nacional a recibir por ventas fecha-valor de divisas

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de venta de cualquier divisa. En este concepto debe incluir la fase activa de futuros de venta operados en el MEXDER con clave de producto "DA" y cuyo plazo sea menor o igual a 4 días hábiles bancarios.

Concepto 10201 y 11800: Moneda nacional a recibir por ventas fecha-valor de acciones

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir, por ventas de acciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

Concepto 10200 y 11801: Moneda nacional a recibir por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir, por ventas de títulos de deuda pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate.

Concepto 10250: Moneda nacional a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportado

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado. En este concepto no deberán incluir operaciones de reporto sobre acciones.

Conceptos 10300 – 10326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por compras pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10350 – 10376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 11290 a 11316.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 11290 a 11316.

Conceptos 10450-10476: Tenencia de títulos

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 deben incluir:

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).

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista, deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir, por reportos de valores (títulos de deuda), actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos actuando como reportado.

Estos conceptos NO aplican 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 incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

Conceptos 10630 – 10656: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés nominal en m.n. distintas a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 10660 – 10686: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés nominal en m.n. distintas a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de compra de tasa de interés nominal m.n. distintas a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de venta de tasa de interés nominal m.n. distintas a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 10750 – 10776: Contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir por contratos adelantados de venta de cualquier divisa. Asimismo, debe reportar el valor 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 deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a recibir por futuros de venta de cualquier divisa. Asimismo, debe reportar el valor de la moneda nacional a recibir por futuros de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 10810 – 10836: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, y distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo: títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 10840 – 10866: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero a recibir de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 10870 – 10896: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, y distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 10900 – 10926: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas - fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 10930 – 10956: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal - fase activa a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés nominal, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 10960 – 10986: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal - fase activa a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 11050 – 11076: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés nominal – fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se reciba cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional distinto de tasa de interés nominal (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 11080 – 11106: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés nominal fija – fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés nominal variable – fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en la que se reciba una tasa de interés nominal variable.

Conceptos 11500– 11526: Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de una tasa de interés nominal en m.n.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 11530– 11556: Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por la tenencia de opciones de venta de una tasa de interés nominal en m.n.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la Casa de Bolsa el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 11560– 11586: **Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 11590– 11616: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

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

Conceptos 11620– 11646: Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por la emisión de opciones de compra sobre cualquier divisa.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 11650– 11676: Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por la tenencia de opciones de venta sobre cualquier divisa.

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

Conceptos 11680– 11706: Moneda nacional a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir de la emisión de opciones y títulos opcionales de compra sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional y distintos de tasa de interés nominal y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 11710 – 11736: Moneda nacional a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al dinero a recibir de la tenencia de opciones y títulos opcionales de venta sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional, distintos de tasa de interés nominal y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

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

Conceptos 11740– 11766: Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por la emisión de las opciones y títulos opcionales de venta sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda nacional, distintos de tasa de interés nominal y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 11770– 11796: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de las opciones y títulos opcionales de compra sobre subyacentes distintos a tasa de interés en moneda nacional y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

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

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 la CUCB, en las que la institución tenga una posición larga.

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

Conceptos 11320– 11346: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa a instrumentos derivados implícitos)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB. De dichos derivados, debe reportar la parte activa de los mismos.

Conceptos 12800– 12826: Otras operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional

En estos conceptos deben incluir, cualquier otra operación, realizada por la casa de bolsa o su filial, que sea objeto del cobro de una tasa nominal en moneda nacional no incluida en cualquiera de los demás conceptos de activos brutos.

Conceptos 11380 – 11406: Futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 11410 – 11436: Futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 11810 – 11836: Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa relativa al subyacente a recibir de las operaciones de futuros de compra de bonos a tasa fija a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 11840 – 11866: Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa relativa al "dinero" a recibir de las operaciones de futuros de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 11870 – 11896: Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa relativa al subyacente a recibir de las operaciones de contratos adelantados de compra de bonos a tasa fija a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 11900 – 11926: Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa relativa al "dinero" (es decir, al precio futuro pactado denominado en moneda nacional) a recibir de las operaciones de contratos adelantados de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

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

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de compra de cualquier divisa. En este concepto deberán incluir los futuros operados en el MEXDER con clave de producto "DA" y cuyo plazo sea menor o igual a 4 días hábiles bancarios.

Conceptos 13250 – 13276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluir los instrumentos de captación a plazo (certificados bursátiles, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, etc.) a cargo de la Casa de Bolsa, con excepción de los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 13350 – 13376: Préstamos y depósitos de bancos

En estos conceptos deben reportar los préstamos y depósitos de bancos.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos y depósitos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución.

Conceptos 13400 y 14901: Moneda nacional a entregar por compras fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar, por compras de títulos de deuda pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate.

Concepto 13401 Y 14900: Moneda nacional a entregar por compras fecha-valor de acciones

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar, por compras de acciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre de mes de que se trate.

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

En estos conceptos debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

En este concepto no deberán incluir operaciones de reporto sobre acciones, ya que éstas son operaciones en contravención a las disposiciones y por tanto deben restarse en su totalidad del Capital Global.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas). El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 14440 a 14466.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 14440 a 14466.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado.

El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 14440 a 14466.

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

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

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los títulos a entregar, por reportos de valores actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Estos conceptos NO aplican 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 no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 14440 a 14466.

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportado.

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

En este concepto no deberán incluir operaciones de reporto sobre acciones.

Conceptos 13780 – 13806: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés nominal en m.n. distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 13810 – 13836: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés nominal en m.n. distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de compra sobre tasa de interés nominal en m.n. distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de venta sobre tasa de interés nominal en m.n. distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 13900 – 13926: Moneda nacional a entregar por Contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar por contratos adelantados de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportar el valor de la moneda nacional a entregar por contratos adelantados de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 13930 – 13956: Moneda nacional a entregar de Futuros de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda nacional a entregar por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportar el valor de la moneda nacional a entregar por futuros de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 13960 – 13986: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 subyacente distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo: títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 13990 – 14016: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, y distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 14020 – 14046: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 14050 – 14076: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés nominal, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 14080 – 14106: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés nominal - fase pasiva a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés nominal - fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 fija 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 incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 fija durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 14200 – 14226: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés nominal–fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva (flujos a entregar) 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 distinto de tasa de interés nominal (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Conceptos 14230 – 14256: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés nominal fija–fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés nominal variable–fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés nominal variable.

Conceptos 14600 – 14626: Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 14630 – 14656: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14660 – 14686: Moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 14690 – 14716: Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

En estos conceptos deben reportar el "valor "delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14720 – 14746: Moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 14750 – 14776: Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14780 – 14806: Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 14810 – 14836: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda nacional).

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14840 – 14866: Moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 14870 – 14896: Moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 14440 – 14466: Posición pasiva en operaciones estructuradas a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluir los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución.

Conceptos 14470 – 14496: Posición pasiva en operaciones estructuradas a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa a los instrumentos derivados implícitos)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB.

De dichos derivados, debe reportar la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 15800 – 15826: Otras operaciones pasivas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda nacional

En estos conceptos deben incluir, cualquier operación realizada por la casa de bolsa o su filial que sea objeto del pago de una tasa nominal en moneda nacional no incluida en cualquiera de los demás conceptos de pasivos brutos.

Conceptos 14530 – 14556: Futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de las operaciones de futuros de compra de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 14560 – 14586: Futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de las operaciones de futuros de venta de operaciones de intercambio de flujos de dinero (swaps) relativos a una tasa de interés nominal a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 14910 – 14936: Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva de las operaciones de futuros de compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 14940 – 14966: Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva de las operaciones de futuros de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 14970 – 14996: Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva de las operaciones de forwards compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 14998 – 15024: Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (el cual incluya el importe nominal correspondiente) de la parte pasiva de las operaciones de forwards de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 02

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC02 RELATIVA A LAS 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 y otras operaciones activas y pasivas 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 27026, 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 "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (el Art. 151 Fracción X de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB)

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 CUCB, 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.

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.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC02

Considerando el procedimiento establecido en la CUCB, 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 23826), 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 CUCB sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 26000 al 27026), 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 de la fracción II del Artículo 152 de la CUCB, 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 la fracción II del Artículo 152 de la CUCB, que a la letra establece:

"*(fracción II del Artículo 152 de la CUCB)* 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 *frac. I del Art. 152 de la CUCB)* 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, emisor, 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.

VIII. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o la parte correspondiente de las mismas, según se trate, deberán informarse al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

IX. COBERTURA DEL FORMULARIO

En particular, en esta sección debe incluir 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 incluir la parte relativa al dinero, en operaciones tales como: compras-ventas fecha valor y reportos.

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 incluir:

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 (Nota A) a cargo del Fondo de Protección al Ahorro (FOBAPROA), y/o a cargo del Instituto de Protección al Ahorro Bancario (IPAB).

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 incluir los títulos de deuda a recibir, por compras fecha-valor pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CNBV.

Conceptos 20350 – 20376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Conceptos 20400 – 20426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 20450 - 20476: Tenencia de títulos

En estos conceptos debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la tenencia de títulos de deuda con tasa de interés revisable que estén vigentes a la fecha de que se trate.

Conceptos 20500 – 20526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista, deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Conceptos 20600 – 20626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos actuando como reportado.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 20700 – 20726: Otras operaciones activas con títulos de deuda en m.n. con sobretasa.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones activas con títulos de deuda en moneda nacional con tasa revisable y sobretasa diferentes a los conceptos anteriores.

El importe de los títulos respectivos debe corresponder a valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Conceptos 23500 – 23526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Conceptos 23550 – 23576: Valores a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Conceptos 23600 – 23626: Títulos a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportado

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 23650 – 23676: Valores a entregar por préstamos de títulos, actuando como prestatario

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

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los títulos a entregar, por reportos de valores actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Estos conceptos NO aplican 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 23800 – 23826: Otras operaciones pasivas con títulos de deuda en m.n. con sobretasa.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones pasivas con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y tasa revisable diferentes a los conceptos anteriores.

El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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 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 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);, bienes en garantía (con transferencia de propiedad) y otras operaciones activas y pasivas que sean objeto de una tasa de interés real en UDIS y en moneda nacional.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC03

La sección RC03 está conformada por los conceptos 30000 al 39106, con dos columnas en donde deberá reportar, 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 "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 y otras figuras similares, 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 reportar considerando las diversas inversiones en títulos de deuda, que formen parte del portafolio de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (el Art. 151 Fracción X de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

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 reportar con signo positivo, ya que cada concepto reconoce la naturaleza de la operación.

La información de esta sección, en sus dos columnas, deberá reportar 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.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la CUCB, 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
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

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.

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 (el Art. 152, fracción I de la CUCB) 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.

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.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con cupones a tasa fija e instrumentos derivados que generen posiciones equivalentes a títulos a tasa fija, el plazo del instrumento, 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 2 de la CUCB.

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 haya más revisiones o ajustes de tasa posteriores.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, 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.

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 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.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC03

Considerando el procedimiento establecido en la CUCB 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 34956), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en las que deberán reportar 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 CUCB sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 36180 al 39106), que comprende diversos apartados y cada uno de éstos 14 bandas, en la que deberán reportar exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total, en términos de Art. 152, fracción II de la CUCB, 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 reportar exclusivamente aquellas operaciones que sean objeto de compensación total con otra operación igual de naturaleza contraria, según lo establecido en la fracción II del Artículo 152 de la CUCB , que a la letra establece:

"*(fracción II del Artículo 152 de* la CUCB*)* 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 frac. I del Art. 152 de la CUCB) 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 Art. 151, frac. VII, 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 frac. VII del Art. 151, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en el segundo párrafo de la frac. VIII del Art. 151 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 frac. I del Art. 152*

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) En el caso de los títulos dicha compensación se efectuará sin distinguir de qué operación provienen el activo y el pasivo.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza.

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).

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.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

Tratándose de opciones o títulos opcionales, se considerará como "valor delta", al resultado de multiplicar el valor de los títulos o instrumentos subyacentes que conforme al criterio que en materia contable establezca la CUB, por el número de títulos o instrumentos subyacentes que ampare la opción por la "delta" de la opción. La "delta" será, para el caso de opciones listadas, la que publique el mercado en donde éstas se coticen y para el caso de que no sea publicada o que se trate de opciones no listadas, la "delta" a utilizar será la que determine la propia casa de bolsa en su modelo de valuación.

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.

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 incluir, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Conceptos 30300 – 30326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por compras pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30350 – 30376: Valores a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos fecha-valor pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30400 – 30426: Títulos a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportador

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 31290 a 31316.

Conceptos 30450 - 30476: Tenencia de títulos

En estos conceptos debe incluir el su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 incluir:

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).

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista, deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos actuando como reportado.

Estos conceptos NO aplican 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 incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

Conceptos 30630 – 30656: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés real distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 30660 – 30686: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés real distintos a los paquetes de contratos adelantados los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

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

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de compra sobre tasa de interés real distintas a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 30720 – 30746: Futuros de venta de tasa de interés real-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de venta de tasa de interés real operaciones distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 30810 – 30836: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real y bonos- fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a recibir de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real y bonos (referidos a INPC, tasa real o UDIS).

Conceptos 30840 – 30866: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero 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 bonos -fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a recibir de futuros de compra de cualquier subyacente de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real y bonos (referidos a INPC, tasa real o UDIS).

Conceptos 30900 – 30926: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero 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 contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real - fase activa a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés real que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real fijo, sobre un importe base fijo durante la vigencia de dicha operación.

Conceptos 30960 – 30986: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real - fase activa a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés real que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés real que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB equivalente a la parte activa de una operación de intercambio de flujos ("swap") en la que se recibe una tasa de interés real, 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 a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés real – fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio de flujos de dinero en las que se reciba cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por estar referido al INPC, tasa real o UDIS.

Conceptos 31080 – 31106: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés real fija – fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés real variable – fase activa

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa (flujos a recibir) de las operaciones de intercambio en las que se reciba una tasa de interés real variable.

Conceptos 31500 – 31526: UDIS a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" del activo a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de una tasa de interés real.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 31530 – 31556: UDIS a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" del activo a recibir por la tenencia de opciones en las que se entregue un rendimiento referido a una tasa de interés real.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la Casa de Bolsa el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 31560 – 31586: **Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en m.n.**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 31590 – 31616: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en m.n.

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

Conceptos 31620 – 31646: UDIS a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" del activo a recibir de la emisión de opciones sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real en moneda nacional y distintos de tasas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS o tasa real).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 31650 – 31676: UDIS a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" del activo al dinero a recibir de la tenencia de opciones sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa real en moneda nacional y distintos de tasas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

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

Conceptos 31680 – 31706: **Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por emisión de las opciones y títulos opcionales de venta sobre subyacentes distintos a tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 31710 – 31736: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de las opciones y títulos opcionales de compra sobre subyacentes distintos a tasa de interés real (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS).

Conceptos 31290 – 31316: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal) a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere el numeral de la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, en las que la institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluir 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) a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa a instrumentos derivados implícitos)

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB. De dichos derivados, debe reportar la parte activa de los mismos que se encuentre denominada en UDIS o referida a una tasa de interés real.

Conceptos 32800 – 32826: Otras operaciones activas en UDIS que sean objeto de una tasa de interés real en moneda nacional

En estos conceptos deben incluir, cualquier otra operación, realizada por la casa de bolsa o su filial, que sea objeto del cobro de una tasa real en moneda nacional no incluida en cualquiera de los demás conceptos de activos brutos.

Conceptos 31740 – 31766: Futuros de compra de bonos a tasa real (fase activa)

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa relativa al subyacente a recibir de las operaciones de futuros de compra de bonos a tasa real o con rendimiento referido a UDIS a los que se refiere la fracción IV del Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 31800 – 31826: Forwards de venta de bonos a tasa real (fase activa)

En estos conceptos debe reportar el su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB) de la parte activa de las operaciones de forwards de venta de bonos a tasa real o con rendimiento referido a UDIS a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

Conceptos 33250 – 33276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluir 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, etc.) a cargo de la Casa de Bolsa, con excepción de los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución. El importe de dichos instrumentos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 33350 – 33376: Préstamos y depósitos de bancos

En estos conceptos deben reportar los préstamos y depósitos de bancos.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos y depósitos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 34440 a 34466.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 34440 a 34466.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado.

El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 34440 a 34466.

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

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

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los títulos a entregar, por reportos de valores actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir los títulos (o notas) estructurados a entregar, ya que los mismos deben reportar en los conceptos 34440 a 34466.

Conceptos 33780 – 33806: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés real distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 33810 – 33836: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés real distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 33840 – 33866: Futuros de compra de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de compra sobre tasa de interés real distintas a los paquetes de futuros de compra de tasa de interés real a los que se refiere la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB.

Conceptos 33870 – 33896: Futuros de venta de tasa de interés real-fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de venta sobre tasa de interés real distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB.

Conceptos 33960 – 33986: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al "dinero" a entregar 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: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real y bonos a tasa real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés real y bonos.

Conceptos 34020 – 34046: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos debe reportar su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al "dinero" 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 y bonos a tasa real- fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado distinto de tasa de interés real y bonos.

Conceptos 34080 – 34106: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 34170 – 34196: Paquetes de futuros de venta de tasa de interés real - fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés real–fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés real fija–fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés real variable–fase pasiva

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva (flujos a entregar) de las operaciones de intercambio en las que se entregue una tasa de interés real variable.

Conceptos 34600– 34626: **Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real.**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 34630 – 34656: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34660 – 34686: UDIS a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés real.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 34690 – 34716: UDIS a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real en m.n.

En estos conceptos deben reportar el "valor "delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés real.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34720 – 34746: **Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS o referidos a una tasa real).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 34750 – 34776: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS o referidos a una tasa real).

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 34780 – 34806: UDIS a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS o referidos a una tasa real).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 34810 – 34836: UDIS a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés real

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés (por ejemplo, títulos de deuda denominados en UDIS o referidos a una tasa real).

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir 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 reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluir 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 reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB.

De dichos derivados, debe reportar la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 35800 – 35826: Operaciones pasivas en UDIS o que sean objeto de una tasa de interés real en moneda nacional

En estos conceptos deben incluir, cualquier operación realizada por la casa de bolsa o su filial en UDIS o que sea objeto del pago de una tasa de interés real no incluida en cualquiera de los demás conceptos de pasivos brutos.

Conceptos 34870 – 34896: Futuros de venta de bonos a tasa real (fase pasiva)

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de las operaciones de futuros de venta de bonos a tasa real a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 34930 – 34956: Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos debe reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de las operaciones de forwards de venta de bonos a tasa real a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

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; bienes en garantía (con transferencia de propiedad) y otras operaciones activas y pasivas que sean objeto de una tasa de interés nominal en moneda extranjera.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC04

La sección RC04 está conformada por los conceptos 40000 al 49316, 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 extranjera, 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 extranjera -por su inversión en el capital variable de "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 y otras figuras similares, 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, con tasa de interés en moneda extranjera que formen parte del portafolio de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción X del Artículo 151 de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

III. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC04

En esta sección se solicita la suma 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 moneda extranjera deberán valorizarse en pesos utilizando el tipo de cambio aplicable conforme a los criterios contables emitidos por la Comisión.

IV. PARTES DE LAS OPERACIONES

Conforme a lo dispuesto en la CUCB, 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
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

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.

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 (el Art. 152, fracción I de la CUCB) 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.

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.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con cupones a tasa fija e instrumentos derivados que generen posiciones equivalentes a títulos a tasa fija, el plazo del instrumento, 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 2 de la CUCB.

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 haya más revisiones o ajustes de tasa posteriores.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, 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.

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 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.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC04

Considerando el procedimiento establecido en la CUCB 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 45086), 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 CUCB sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 46145 al 49316), 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 Art. 152, fracción II de la CUCB y 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 la fracción II del Artículo 152 de la CUCB, que a la letra establece:

"*(fracción II del Artículo 152 de la CUCB)* 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 (*frac. I del Art. 152 de la CUCB)* 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*(frac. VII del Art. 151)*, 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 *(frac. VII del Art. 151)*, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en *(frac. VIII del Art. 151)* 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 *(frac. I del Art. 152)*

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.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza.

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).

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.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

Tratándose de opciones o títulos opcionales, se considerará como "valor delta", al resultado de multiplicar el valor de los títulos o instrumentos subyacentes que conforme al criterio que en materia contable establezca la CUB, por el número de títulos o instrumentos subyacentes que ampare la opción por la "delta" de la opción. La "delta" será, para el caso de opciones listadas, la que publique el mercado en donde éstas se coticen y para el caso de que no sea publicada o que se trate de opciones no listadas, la "delta" a utilizar será la que determine la propia casa de bolsa en su modelo de valuación.

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.

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 incluir las disponibilidades distintas de depósitos bancarios a plazo. A discreción de la Casa de Bolsa, en este concepto podrá incluir el saldo de caja.

Conceptos 40100 – 40126: Depósitos bancarios a plazo

En estos conceptos deben incluir, entre otros, los depósitos a plazo en bancos, tanto los residentes en México como en otros países. Asimismo, deben incluir los depósitos a plazo en Banco de México. El importe de dichos depósitos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal y, en su caso, intereses devengados no cobrados).

Concepto 40195: Moneda extranjera a recibir por compras fecha-valor de divisas

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de compra de cualquier divisa.

Concepto 40197: Moneda extranjera a recibir por ventas fecha-valor de divisas

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de venta de cualquier divisa.

Concepto 40200 y 41859: Moneda extranjera a recibir por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir, por ventas de títulos de deuda pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate.

Concepto 40201 y 41860: Moneda extranjera a recibir por ventas fecha-valor de acciones

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir, por ventas de acciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

Concepto 40250: Moneda extranjera a recibir por reportos fecha-valor, actuando como reportado

En este concepto deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado. En este concepto no deberán incluir operaciones de reporto sobre acciones.

Conceptos 40300 – 40326: Valores a recibir por compras fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por compras pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir 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 incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir 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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir 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 incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 deben incluir:

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).

Conceptos 40500 – 40526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista, deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

En estos conceptos no deben incluir 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 estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir, por reportos de valores (títulos de deuda), actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Conceptos 40600 – 40626: Títulos a recibir por operaciones de reporto, actuando como reportado

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos actuando como reportado.

Estos conceptos NO aplican 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 incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

En estos conceptos no debe incluir los títulos (o notas) estructurados a recibir, ya que los mismos deben reportarse en los conceptos 41380 a 41406.

Conceptos 40630 – 40656: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 40660 – 40686: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 40690 – 40716: Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de compra de tasa de interés nominal moneda extranjera distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 40720 – 40746: Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase activa

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de futuros de venta de tasa de interés nominal moneda extranjera distinta a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 40750 – 40776: Moneda extranjera a recibir por Contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 40780 – 40806: Moneda extranjera a recibir por Contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por contratos adelantados de venta de cualquier divisa.

Conceptos 40810 – 40836: Moneda extranjera a recibir por Futuros de compra de divisas-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor de la moneda extranjera a recibir por futuros de venta de pesos mexicanos.

Conceptos 40840 – 40866: Moneda extranjera a recibir por Futuros de venta de divisas-fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a recibir por futuros de venta de cualquier divisa.

Conceptos 40870 – 40896: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, y distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 40900 – 40926: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero a recibir de contratos adelantados de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 40930 – 40956: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 40960 – 40986: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas - fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero a recibir de futuros de venta de cualquier subyacente distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 40990 – 41016: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa, a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 41020 – 41046: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase activa, a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, a los que se refiere el Art. 151 fracción VIII de la CUCB

En estos conceptos deben incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 41110 – 41136: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 en moneda extranjera, y distinto de tasa de interés en moneda extranjera (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 41140 – 41166: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés fija en moneda extranjera – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se reciba una tasa de interés variable en moneda extranjera – fase activa

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 41500– 41526: Moneda extranjera a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de una tasa de interés nominal en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41530– 41556: Moneda extranjera a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por la tenencia de opciones de venta de una tasa de interés nominal en moneda extranjera.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la Casa de Bolsa el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Deben incluir 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: Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41590– 41616: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

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

Conceptos 41620 – 41646: Moneda extranjera a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a recibir por la emisión de opciones de compra sobre cualquier divisa.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41650 – 41676: Moneda extranjera a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a recibir por la tenencia de opciones de venta de cualquier divisa.

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

Conceptos 41680 – 41706: Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por la emisión de las opciones de venta sobre cualquier divisa.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41710 – 41736: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de las opciones y títulos opcionales de compra sobre cualquier divisa.

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

Conceptos 41740 – 41766: Moneda extranjera a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a recibir de la emisión de opciones y títulos opcionales de compra sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera, distintos de tasa de interés nominal en m.e. y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41770 – 41796: Moneda extranjera a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al dinero a recibir de la tenencia de opciones y títulos opcionales de venta sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera, distintos de tasa de interés nominal en m.e. y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

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

Conceptos 41800 – 41826: **Subyacente a recibir, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas**

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por la emisión de las opciones de venta sobre subyacentes sujetos a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera, distintos de tasa de interés nominal m.e. y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 41830 – 41856: Subyacente a recibir, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de las opciones y títulos opcionales de compra sobre subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

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

Conceptos 41380 – 41406: Posición activa en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, en las que la institución tenga una posición larga.

Entre otras operaciones, debe incluir 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB.

De dichos derivados, debe reportarse la parte activa de los mismos.

Conceptos 42800 – 42826: Otras operaciones activas que sean objeto de una tasa de interés en moneda extranjera

En estos conceptos deben incluir, cualquier otra operación, realizada por la casa de bolsa o su filial, que sea objeto del cobro de una tasa nominal en moneda extranjera no incluida en cualquiera de los demás conceptos de activos brutos.

Conceptos 41870 – 41896: Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 41900 – 41926: Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 41930 – 41956: Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos deben reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de forwards compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 41960 – 41986: Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase activa)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de forwards de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos.

Concepto 43195: Moneda extranjera a entregar por compras fecha-valor de divisas

En este concepto debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de compra de cualquier divisa.

Concepto 43197: Moneda extranjera a entregar por ventas fecha-valor de divisas

En este concepto debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por operaciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) de venta de cualquier divisa.

Conceptos 43250 – 43276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluir 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, 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal e intereses devengados no pagados).

Conceptos 43350 – 43376: Préstamos y Depósitos de Bancos

En estos conceptos deben reportar los préstamos y depósitos de bancos.

Para determinar la moneda, rendimiento y plazo de los préstamos y depósitos se considerarán las características del financiamiento recibido por la institución.

Conceptos 43400 y 44959: Moneda extranjera a entregar por compras fecha-valor de títulos

En este concepto debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar, por compras de títulos pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre de mes de que se trate.

Concepto 43401 y 44960: Moneda extranjera a entregar por compras fecha-valor de acciones

En este concepto debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar, por compras de acciones pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre de mes de que se trate.

Concepto 43450: Moneda extranjera a entregar por reportos fecha-valor, actuando como reportador

En estos conceptos debe incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador. En este concepto no deberán incluir operaciones de reporto sobre acciones, ya que éstas son operaciones en contravención a las disposiciones y por tanto deben restarse en su totalidad del Capital Global.

Conceptos 43500 – 43526: Valores a entregar por ventas fecha-valor de títulos

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por ventas fecha-valor pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas). El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir 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 incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. En estos conceptos no deben incluir 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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado.

El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir 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 incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

En estos conceptos no deben incluir 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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los títulos a entregar, por reportos de valores actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Estos conceptos NO aplican 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 no debe incluir 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 incluir su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar, por reportos de valores (títulos de deuda y/o acciones), actuando como reportado.

En estos conceptos deben incluir 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: Contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de compra sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 43810 – 43836: Contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de contratos adelantados de venta sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de contratos adelantados a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 43840 – 43866: Futuros de compra de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de compra sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 43870 – 43896: Futuros de venta de tasa de interés en moneda extranjera-fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte pasiva de futuros de venta sobre tasa de interés nominal en moneda extranjera distintos a los paquetes de futuros a los que se refiere el Art. 151 Fracción VIII de la CUCB.

Conceptos 43900 – 43926: Moneda extranjera por Contratos adelantados ("forwards") de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por contratos adelantados de compra de cualquier divisa.

Conceptos 43930 – 43956: Moneda extranjera por Contratos adelantados ("forwards") de venta de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por contratos adelantados de venta de cualquier divisa.

Conceptos 43960 – 43986: Moneda extranjera por Futuros de compra de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por futuros de compra de cualquier divisa. Asimismo, debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por futuros de compra de pesos mexicanos.

Conceptos 43990 – 44016: Moneda extranjera por Futuros de venta de divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la moneda extranjera a entregar por futuros de venta de cualquier divisa.

Conceptos 44020 – 44046: Contratos adelantados ("forwards") de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero entregar de contratos adelantados de compra de cualquier subyacente distinto

de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 44050 – 44076: Contratos adelantados ("forwards") de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 extranjera, y distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 44080 – 44106: Futuros de compra de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al dinero entregar de futuros de compra de cualquier subyacente distinto de tasa de interés en moneda extranjera y divisas (por ejemplo, títulos de deuda, acciones o índices accionarios).

Conceptos 44110 – 44136: Futuros de venta de subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas -fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar de futuros de venta de cualquier subyacente sujeto a riesgo de mercado por tasa en moneda extranjera, y distinto de tasa de interés en moneda extranjera, bonos a tasa fija y divisas (por ejemplo títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 44140 – 44166: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de compra de tasa de interés en moneda extranjera- fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 44170 – 44196: Paquetes de contratos adelantados ("forwards") de venta de tasa de interés en moneda extranjera - fase pasiva

En estos conceptos deben incluir únicamente los contratos adelantados de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 incluir únicamente los futuros de compra de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 incluir únicamente los futuros de venta de tasa de interés que cumplan con lo mencionado en la fracción VIII del Artículo 151 de la CUCB. Al efecto debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 44260 – 44286: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") relativas a subyacentes distintos a tasa de interés en moneda extranjera–fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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, y distinto de tasa de interés en moneda extranjera (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Conceptos 44290 – 44316: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés fija en moneda extranjera –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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: Operaciones de intercambio de flujos de dinero ("swaps") en las que se entregue una tasa de interés variable en moneda extranjera –fase pasiva

En estos conceptos debe reportarse a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 44600 – 44626: Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44630 – 44656: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44660 – 44686: Moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44690 – 44716: Moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés en m.e.

En estos conceptos deben reportar el "valor "delta" de la moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de tasa de interés nominal en moneda extranjera.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44720 – 44746: Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44750 – 44776: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44780 – 44806: Moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de divisas.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44810 – 44836: Moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de divisas.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44840 – 44866: Subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44870 – 44896: Subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas (por ejemplo, títulos de deuda denominados en moneda extranjera).

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44900 – 44926: Moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 44930 – 44956: Moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda extranjera a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes distintos a tasa de interés y divisas.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 44530 – 44556: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa al contrato principal) a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa a instrumentos derivados)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, en las que la institución tenga una posición corta.

Entre otras operaciones, debe incluir los títulos o notas estructuradas emitidos por la propia institución.

Conceptos 44560 – 44586: Posición pasiva en operaciones estructuradas (parte relativa a los derivados implícitos) a los que se refiere el Art. 151 fracción IX de la CUCB (parte relativa a instrumentos derivados)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 45800 – 45826: Operaciones pasivas que sean objeto de una tasa de interés en moneda extranjera

En estos conceptos deben incluir, cualquier operación realizada por la casa de bolsa o su filial que sea objeto del pago de una tasa nominal en moneda extranjera no incluida en cualquiera de los demás conceptos de pasivos brutos.

Conceptos 44970 – 44996: Futuros de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 45000 – 45026: Futuros de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de futuros de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 45030 – 45056: Forwards de compra de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos deben reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de forwards compra de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Conceptos 45060 – 45086: Forwards de venta de bonos a tasa fija (fase pasiva)

En estos conceptos debe reportarse el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de las operaciones de forwards de venta de bonos a tasa fija a los que se refiere el Art. 151 de la CUCB.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 05

AYUDAS ESPECÍFICAS DE LA SECCIÓN RC05

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.

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"-, derivadas de: la tenencia de "acciones"; operaciones - con "acciones" - de compra, venta, préstamo, futuro, 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; 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.

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".

En esta sección se reportarán las inversiones en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo o indizados cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que si cuenten con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes.

A partir de febrero 2018 se consideran las inversiones en acciones (incluidas las inversiones en el patrimonio fijo, bajo cualquier modalidad de participación) de las bolsas de valores

A partir de febrero 2018 también se considerarán las acciones de instituciones para depósitos de valores.

En esta sección NO deberán incluirse las inversiones, directas e indirectas, en:

- Acciones de controladoras de grupos financieros; acciones de entidades financieras del país y del exterior; acciones representativas del capital fijo de sociedades de inversión; patrimonio fijo (capital), bajo cualquier modalidad de participación, de fondos de inversión; acciones de sociedades operadoras de sociedades 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 cámaras de compensación o fideicomisos o figuras similares que tengan por finalidad compensar o liquidar operaciones celebradas en bolsa.
- 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 sociedades de inversión (o 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 de la sociedad de inversión de que se trate sin considerar las relativas al Capital Fijo.
- Las demás inversiones en acciones (o parte de las inversiones según sea el caso) que se resten al determinar el Capital Neto.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC05

La sección RC05 está conformada por los conceptos 50000 a 54200, 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 - por su inversión en el capital variable de "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 (que no sean "sociedades de inversión") y otras figuras similares, 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 de que esté conformado el portafolio de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción X del Artículo 151 e inciso d) de la fracción I del Artículo 157 de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

Las inversiones en el capital variable de sociedades de inversión (o 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 la citada sociedad de inversión (o fondos de inversión), serán consideradas para efectos del cómputo como una posición individual y deberán reportarse dentro de la columna 1.

A partir del concepto 52050 se incluirá en la columna 1 la información total del portafolio, sumando las operaciones previamente incluidas en las columnas 1 y 2, por lo tanto de dicho concepto 52050 en adelante la columna 2 no deberá presentar saldo.

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 "sociedades de inversión" y las inversiones efectuadas 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 deberán realizarse, en su caso, por cada posición accionaria y conforme al procedimiento que establece el artículo 157 de la CUCB.

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.

Las "acciones" deberán reportarse al valor conforme a los criterios que en materia contable establece la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en la CUCB y su anexo 11 de las mismas.

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

VI. ACLARACIONES DIVERSAS DE LA SECCIÓN RC05

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 el numeral del inciso b) el inciso c) del Artículo 157 de la CUCB).

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 inciso a) de la fracción I del Artículo 157 de la CUCB.

VII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC05

Concepto 50050: Acciones a recibir por compras fecha-valor

Valor conforme al criterio que en materia contable establece la CUB del total de las "acciones" a recibir por compras ya concertadas, pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas.

Concepto 50100: Tenencia de acciones

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" en tenencia propia. Incluye la totalidad 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".

Concepto 50110: Inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" de empresas cotizadas (distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias) cuya tenencia sea mayor al 15% del capital de la emisora.

Se entiende como inversión permanente, cuando tales acciones se mantengan en posición propia por un periodo superior a seis meses.

Conforme a la fracción IV del art. 160, estas inversiones tienen un requerimiento de capital del ocho por ciento adicional al establecido en el artículo 157, por lo cual también deben reportarse en la sección RC08 en la sección de inversiones permanentes y otros activos.

Concepto 50115: Inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas y no cotizadas

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" de empresas de empresas cotizadas y no cotizadas (distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto no se incluyen en las demás secciones del formulario.

Concepto 50150: Acciones a recibir por préstamos fecha-valor, actuando como prestatario

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" por recibir, adquiridas en préstamo, actuando como prestatario (operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

Concepto 50200: Acciones a recibir por préstamos vigentes actuando como prestamista

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" a recibir, cedidas en préstamo, actuando como prestamista (conforme al inciso b) de la fracción I del Artículo 157 de la CUCB). 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 entregado.

Concepto 50250: Acciones a recibir por Contratos Adelantados –forwards– de compra

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" subyacentes a recibir por operaciones de contratos adelantados (forwards) de compra.

Concepto 50255: Acciones a recibir por futuros de compra

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" subyacentes a recibir por operaciones de futuro de compra.

Concepto 50300: Acciones a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta

Posición equivalente a la de las acciones subyacentes, al valor que resulte de multiplicar el precio actualizado de la valuación de acciones de que se trate, por el número de acciones que ampare la opción o título opcional y por la "delta" de la opción

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones de emisión de opciones y títulos opcionales.

Concepto 50350: Acciones a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra

Posición equivalente a la de las acciones subyacentes, al valor que resulte de multiplicar el precio actualizado de la valuación de acciones de que se trate, por el número de acciones que ampare la opción o título opcional y por la "delta" de la opción.

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".

Concepto 50400: Acciones a recibir por operaciones vigentes de "swaps"

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones", respecto de las cuales se pactó el intercambio de flujos.

Concepto 50550: Tenencia de títulos de deuda cuyo rendimiento esté referido al precio de una acción o de varias acciones

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. 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 Información de Capitalización, Crédito y Estados Financieros, 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.

Concepto 50600: Tenencia de opciones sobre futuros de compra de "acciones"

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).

Concepto 50650: Acciones a recibir, relativas a garantías otorgadas con transferencia de propiedad

Valor conforme al criterio contable de las "acciones" a recibir, cedidas en garantía con transferencia de propiedad. Deben incluirse todas las "acciones" cedidas en garantía, sin importar la operación que se esté garantizando.

Concepto 50700: Operaciones activas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados

Valor conforme al criterio contable de las operaciones activas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados, cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que si se cuente con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes conforme a la fracción III del Art. 160 de las Disposiciones.

Concepto 50900: Otras operaciones activas referidas a una o varias acciones, o índices accionarios

Las operaciones activas celebradas por la institución, relativas a "acciones", que no queden comprendidas en los conceptos anteriores, deberán ser informadas en este concepto. 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.

Concepto 51050: Acciones a entregar por ventas fecha-valor

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" a entregar por ventas ya concertadas, pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas.

Concepto 51150: Acciones a entregar por préstamos fecha-valor, actuando como prestamista

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" por entregar, cedidas en préstamo, actuando como prestamista (operaciones ya concertadas pendientes de liquidar, fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas).

Concepto 51200: Acciones a entregar por préstamos vigentes actuando como prestatario

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" a entregar, adquiridas en préstamo, actuando como prestatario (conforme al inciso b) de la fracción I del Artículo 157 de la CUCB). 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.

Concepto 51250: Acciones a entregar por Contratos Adelantados –forwards– de venta

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" subyacentes a entregar por operaciones de contratos adelantados (forwards), de venta.

Concepto 51255: Acciones a entregar por futuros de venta

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones" subyacentes a entregar por operaciones de futuro, de venta.

Concepto 51300: Acciones a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra

Posición equivalente a la de las acciones subyacentes, al valor que resulte de multiplicar el precio actualizado de la valuación de acciones de que se trate, por el número de acciones que ampare la opción o título opcional y por la "delta" de la opción.

Sin excepción deben incluirse todas las operaciones de emisión de opciones y títulos opcionales.

Concepto 51350: Acciones a entregar por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta

Posición equivalente a la de las acciones subyacentes, al valor que resulte de multiplicar el precio actualizado de la valuación de acciones de que se trate, por el número de acciones que ampare la opción o título opcional y por la "delta" de la opción.

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".

Concepto 51400: Acciones a entregar por operaciones vigentes de "swaps"

Valor conforme al criterio contable del total de las "acciones", respecto de las cuales se pactó el intercambio de flujos.

Concepto 51550: Emisión de títulos de deuda cuyo rendimiento esté referido al precio de una acción o de varias acciones

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 Información de Capitalización, Crédito y Estados Financieros, 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.

Concepto 51600: Tenencia de opciones sobre futuros de venta de "acciones"

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, canasta o índice de que se trate, en operaciones celebradas el día último del mes, sea mayor al "precio establecido en la opción" de que se trate (fuera del dinero).

Concepto 51650: Acciones a entregar, relativas a garantías recibidas con transferencia de propiedad –recibidas–

Valor conforme al criterio contable de las "acciones" a entregar, recibidas en garantía con transferencia de propiedad. Deben incluirse todas las "acciones" recibidas en garantía, sin importar la operación que se esté garantizando.

Concepto 51700: Operaciones pasivas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados

Valor conforme al criterio contable de las operaciones activas con certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados, cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos en las que si se cuente con la información para determinar el requerimiento de capital de dichos activos subyacentes conforme a la fracción III del Art. 160 de las Disposiciones.

Concepto 51900: Otras operaciones pasivas referidas a una o varias acciones, o índices accionarios

Las operaciones pasivas celebradas por la institución, relativas a "acciones", que no queden comprendidas en los conceptos anteriores, deberán ser informadas en este concepto. 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.

Concepto 52050: Importe sujeto a compensación

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 serie accionaria (inciso a) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB.

Concepto 52100: Posición total larga

Suma de las posiciones netas largas por cada serie accionaria (conforme a inciso b) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB.

Este concepto deberá ser igual a la diferencia positiva de la suma de los conceptos 50050 al 50900 menos 52050.

Concepto 52150: Posición total corta

Suma de las posiciones netas cortas por cada serie accionaria (conforme a inciso b) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB).

Este concepto deberá ser igual a la diferencia positiva de la suma de los conceptos 51050 al 51900 menos 52050.

Concepto 52200: Posición neta positiva del portafolio

En este concepto deberá reportarse el importe positivo resultante de la diferencia entre la posición total larga - concepto 52100 - y la posición total corta –concepto 52150 - (conforme a inciso c) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB). En caso de que dicho importe sea negativo, en este concepto deberá reportarse 0 (cero), y el valor absoluto de tal resultado negativo deberá informarse en el concepto 52250.

Concepto 52250: Posición neta negativa del portafolio

En este concepto deberá reportarse el valor absoluto del importe negativo resultante de la diferencia entre la posición total larga - concepto 52100 - y la posición total corta - concepto 52150 - (conforme al inciso c) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB). En caso de que dicho importe sea positivo, en este concepto deberá reportarse 0 (cero), y tal resultado positivo deberá informarse en el concepto 52200.

Concepto 55050: Importe sujeto a compensación de certificados bursátiles inmobiliarios, de desarrollo e indizados

Suma de los montos que se compensan (la parte de la posición activa con la parte de la posición pasiva de certificados bursátiles inmobiliarios, de desarrollo e indizados) al determinar la posición neta de cada serie accionaria (inciso a) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB.

Concepto 55100: Posición total larga del portafolio de certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados

Suma de las posiciones netas largas por cada serie accionaria (conforme a inciso b) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB.

Este concepto deberá ser igual a la diferencia entre 50700 menos 55050.

Concepto 55150: Posición total corta del portafolio de certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados

Suma de las posiciones netas corta por cada serie accionaria (conforme a inciso b) de la fracción II del Artículo 157 de la CUCB.

Este concepto deberá ser igual a la diferencia entre 51700 menos 55050

Concepto 54055: Posición neta larga en oro

Valor conforme al criterio contable de las operaciones activas con metales precisos. En este concepto se deberá reportar la posición neta larga en oro, conforme al Art. 156 de las Disposiciones.

Este concepto se sumará a la posición neta larga en divisas para determinar el requerimiento.

Concepto 54105: Posición neta larga en plata

Valor conforme al criterio contable de las operaciones activas con metales precisos. En este concepto se deberá reportar la posición neta larga en plata, conforme al Art. 156 de las Disposiciones.

Este concepto se sumará a la posición neta larga en divisas para determinar el requerimiento.

Concepto 54150: Posición neta corta en oro

Valor conforme al criterio contable de las operaciones pasivas con metales precisos. En este concepto se deberá reportar la posición neta corta en oro, conforme al Art. 156 de las Disposiciones.

Este concepto se sumará a la posición neta corta en divisas para determinar el requerimiento.

Concepto 54200: Posición neta corta en plata

Valor conforme al criterio contable de las operaciones pasivas con metales precisos. En este concepto se deberá reportar la posición neta corta en plata, conforme al Art. 156 de las Disposiciones.

Este concepto se sumará a la posición neta corta en divisas para determinar el requerimiento.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 06

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC06 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO (CONTRAPARTE) EN OPERACIONES DE REPORTO Y DE DERIVADOS

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC06

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito (contraparte) en las operaciones de reporto, intercambio de flujos de dinero (swap), contratos adelantados, préstamo de valores y opciones.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC06

En esta sección deberán incluirse todas las operaciones (reportos, swaps, contratos adelantados, etc.) de la institución, así como, según lo señalado en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB), del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", cuando la institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dichos fondos para hacer frente a sus obligaciones. Las operaciones de dicho fondo deben incluirse en el apartado que inicia en el concepto 68010 y termina en el 68293.

En esta sección NO deberán incluirse (por simplificación en el llenado y por el nulo impacto en el requerimiento):

- Las operaciones de compra-venta al contado de metales preciosos (liquidables fecha valor 24, 48, 72 o 96 horas, según se trate).

III. CONCEPTOS Y COLUMNA DE LA SECCIÓN RC06

La sección RC06 está conformada por los conceptos 60010 a 69510, con una columna en donde deberá reportarse la información, tanto de las operaciones de la Institución en las oficinas en México, como las operaciones de la Institución en las agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC06

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

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

Las cifras de esta sección deberán determinarse:

A) Realizando los cálculos operación por operación.

B) Valuando en su propia moneda y por separado cada parte de la operación (activo o subyacente a recibir, pasivo o subyacente a entregar y garantías). El valor es conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

Tratándose de la tenencia de opciones y títulos opcionales (warrants), tanto de compra como de venta, el importe positivo será el importe equivalente a su precio actualizado de valuación.

C) En su caso, convirtiendo a pesos las operaciones. Al efecto las operaciones en UDIS o en moneda extranjera, deberán 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.

Sin perjuicio de lo señalado en este inciso y en el B) anterior, en las instrucciones específicas de ciertos conceptos, según se trate, se señalan los precios, tipos de cambio, INPC, etc., aplicables para efectos de este reporte a tales conceptos.

D) Determinando si hay o no "importe positivo" a favor de la institución en cada una de las operaciones, y agrupando por un lado las operaciones en las que no haya importe positivo a favor de la institución y por el otro las operaciones en las que si haya "importe positivo" a favor de la institución (para determinar si hay o no importe positivo se procederá conforme al Artículo 160 de la CUCB y a la "ayuda específica" insertada en cada apartado de esta sección).

E) Clasificando las operaciones conforme al grupo al que pertenezca la contraparte de la operación (no el emisor del subyacente) y tratándose de operaciones derivadas considerando el medio de liquidación (distinguir las liquidadas en mercados no reconocidos de los que se liquiden en cámaras de compensación).

F) Realizando para cada concepto de la sección la suma de las respectivas operaciones según los cálculos individuales, antes mencionados.

V. CLASIFICACIÓN Y CÓMPUTO DE LAS OPERACIONES CON ESTADOS Y MUNICIPIOS

Las operaciones de reportos y derivadas realizadas por la institución con Gobiernos de Estados y Municipios, incluyendo al del Distrito Federal, o con Organismos Descentralizados de éstos, deberán reportarse exclusivamente en los conceptos 60010 a 64793, según el tipo de operación, formando parte de los apartados relativos al grupo RC-2.

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC06

Conceptos 60010 – 60293: Operaciones de Reporto Actuando como Reportador

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (fracción I del Artículo 160 de la CUCB):

RC = DF – G

Donde:

DF = Importe positivo resultante de restar, al valor del dinero a recibir, el valor de los títulos a entregar.

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda).

En caso contrario se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 60310 – 60593: Operaciones de Reporto Actuando como Reportado

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (inciso a) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB):

RC = DF – G

Donde:

DF = Importe positivo resultante de restar, al valor de los títulos, el valor del dinero a entregar.

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda).

En caso contrario se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 60610 - 60893 y 65000 – 65135: Operaciones de Intercambio de Flujos de Dinero ("Swaps")

60610 - 60893 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65000 - 65135 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (inciso b) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB):

RC = DF – G

Donde:

DF = Importe positivo resultante de restar, al valor de los flujos a recibir (a favor), el valor de los flujos a entregar (a cargo).

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda).

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 61510 - 61793 y 65140 – 65275: Contratos Adelantados ("Forwards") de Compra de Divisas

61510 - 61793 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65140 - 65275 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (inciso c) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB):

RC = DF – G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 61810 - 62093 y 65280 - 65415: Contratos Adelantados ("Forwards") de Venta de Divisas

61810 - 62093 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65280 - 65415 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (fracción I del Artículo 160 de las Disposiciones):

RC = DF – G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay importe positivo a favor de la Institución.

Conceptos 62110 - 62393 y 65420 - 65555: Contratos Adelantados ("Forwards") y Futuros de Compra de Tasas de Interés

62110 - 62393 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65420 - 65555 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (inciso c) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB:

RC = DF - G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 62410 - 62693 y 65560 - 65695: Contratos Adelantados ("Forwards") y Futuros de Venta de Tasas de Interés

62410 - 62693 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65560 - 65695 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero (inciso c) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB:

RC = DF - G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 63310 - 63593 y 65700 - 65835: Contratos Adelantados ("Forwards") y Futuros de Compra de Subyacentes distintos a Divisas y Tasas de Interés

63310 - 63593 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65700 - 65835 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

En estos conceptos deberán incluirse los contratos adelantados de compra de subyacentes tales como: títulos de deuda, acciones, canasta de acciones, índices accionarios, etc.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero inciso c) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB:

RC = DF - G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Concepto 63610 - 63893 y 65840 - 65975: Contratos Adelantados ("Forwards") y Futuros de Venta de Subyacentes distintos a Divisas y Tasas de Interés

63610 - 63893 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65840 - 65975 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

En estos conceptos deberán incluirse los contratos adelantados de venta de subyacentes tales como: títulos de deuda, acciones, canasta de acciones, índices accionarios, etc.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución, cuando el resultado de aplicar la siguiente fórmula sea mayor que cero fracción I del Artículo 160 de la CUCB:

RC = DF - G

Donde:

G = Valor de las garantías recibidas (específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponda) y/o importe de las liquidaciones recibidas al día de que se trate respecto de DF.

DF = N * DP

Donde:

N = Número de unidades del bien objeto de la operación.

DP = Diferencial positivo que resulte de restar, al valor del activo a recibir, el valor del pasivo a entregar.

Si el resultado de la fórmula anterior no es mayor a cero, se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 63910 - 64193: Operaciones de Préstamos de Valores actuando como Prestamista

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución, cuando el valor razonable del título prestado sea superior al valor razonable de las garantías recibidas, específicas de la operación de que se trate, o la parte proporcional que le corresponde fracción I del Art. 160 de la CUCB. De no ser así se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 64210 - 64493 y 65980 - 66115: Tenencia de Opciones y Títulos Opcionales ("Warrants") de Compra

64210 - 64493 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

65980 - 66115 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución, cuando el valor razonable del subyacente a recibir sea mayor que el resultado de sumar el valor razonable del dinero a entregar más las garantías recibidas. En caso contrario se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 64510 - 64793 y 66120 - 66255: Tenencia de Opciones y Títulos Opcionales ("Warrants") de Venta

64510 - 64793 Se reporta las operaciones liquidadas en mercados no reconocidos.

66120 - 66255 Se reportan las operaciones liquidadas en cámaras de compensación autorizadas por las SHCP, o establecidas en el exterior reconocidas por Banco de México o establecidas en países cuyas autoridades financieras sean miembros designados para conformar el consejo de la organización internacional de comisiones de valores.

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución cuando el valor razonable del dinero a recibir sea mayor que el resultado de sumar el valor razonable del subyacente a entregar más las garantías recibidas. En caso contrario se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 68010 - 68293: Operaciones de Reporto y Derivadas realizadas por parte del "Fondo de Reserva" de la Institución

En estos conceptos deberá reportarse la suma de los cálculos de todas las operaciones de reporto y derivadas (swaps, forwards, opciones, etc.); realizadas por parte del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", de la Institución, cuando la Institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dicho fondo para hacer frente a sus obligaciones.

Para determinar si hay "importe positivo" a favor de la Institución, deberá seguirse el mismo procedimiento establecido en la ayuda específica (de los conceptos 60010 a 64793) de la operación de que se trate.

Conceptos 69110 - 69245: Operaciones con Instituciones de Banca Múltiple que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores

En estos conceptos deberá reportarse la suma de los cálculos de todas las operaciones de reporto, derivadas(swaps, forward, opciones, etc) así como las realizadas por fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", de la Institución, cuando la Institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dicho fondo para hacer frente a sus obligaciones que se realicen con instituciones de Banca Múltiple que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores.

Para determinar si hay "importe positivo" a favor de la Institución, deberá seguirse el mismo procedimiento establecido en la ayuda específica (de los conceptos 60010 a 64793) de la operación de que se trate.

Conceptos 69300 - 69440: Operaciones de Préstamos de Valores actuando como Prestatario

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución, cuando al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los valores recibidos en préstamos será mayor que el valor de las garantías entregadas. De no ser así se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Conceptos 69450 - 69510: Operaciones de Compra Venta al contado de Divisas y Títulos

Se considerará que hay "importe positivo" a favor de la Institución, cuando el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB del activo a recibir sea superior al valor del pasivo a entregar. De no ser así se considerará que no hay "importe positivo" a favor de la Institución.

Estos conceptos ponderan al 0%.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 07

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC07 RELATIVA AL RIESGO DE CRÉDITO (EMISOR) 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 (emisor) 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, 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 deberán incluirse los valores, cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la institución.

Según lo señalado en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB), en esta sección deberán incluirse las inversiones y operaciones del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", relativas a títulos de deuda, cuando la Institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dichos fondos para hacer frente a sus obligaciones. Estas últimas deben incluirse en el apartado que inicia en el concepto 75002 y termina en el 75295.

En esta sección se reportarán los certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados cuyos recursos se destinen a otorgar créditos o invertir en financiamientos.

En esta sección NO deberán 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 sociedades controladoras de grupos financieros; inversiones en cualquier "instrumento de deuda" cuyo pago por parte del emisor 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.

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC07

La sección RC07 está conformada por los conceptos 70002 a 77233, con cuatro columnas en donde deberá 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 "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión) - derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 (que no sean "sociedades de inversión") y otras figuras similares, 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 en títulos de deuda de que esté conformado el portafolio de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma.

Sin perjuicio de lo señalado en el inciso C) de la "instrucción VI", los valores adquiridos por las sociedades o fondos de inversión mediante operaciones de reporto, se considerarán como inversiones que deben clasificarse en el "apartado" y "grupo" relativos, respectivamente, a la tasa de interés y la 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 Casa de Bolsa): sus operaciones directas deberán reportarlas en la columna 1; las inversiones realizadas indirectamente a través de "sociedades de inversión" y las inversiones efectuadas 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 RC07

En esta sección se solicita la suma de las operaciones a que cada concepto se refiere, sin embargo las compensaciones, 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 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, deberán 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 deberán reportarse conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

VI. APARTADOS DE LA SECCIÓN RC07

Cada uno de los siete apartados de esta sección se calculará:

A) Las posiciones brutas largas, las brutas cortas así como los importes de las posiciones largas y cortas en el mismo título.

Posiciones Brutas Largas

Para determinar este concepto se sumarán los importes de los títulos de deuda que impliquen una posición bruta larga por cualquier operación, a saber:

- 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.
- 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, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas.
- 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.

Posiciones Brutas Cortas

Para determinar este concepto se sumarán los importes de los títulos de deuda que impliquen una posición bruta corta por cualquier operación, a saber:

- 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, liquidables con entrega del subyacente. Incluye exclusivamente las operaciones cuya liquidación, respecto al día último del mes de que se trate, se dará durante las siguientes 96 horas.
- 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.

Largas y Cortas en el Mismo Título

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, emisor, fecha de vencimiento, tipo de cupón y fecha de revisión del cupón.

B) Clasificando las posiciones de acuerdo a la moneda y tasa de rendimiento de referencia del título de deuda, de la siguiente manera:

- Del concepto 70002 al 70233: Títulos en M.N. con tasa de interés nominal.
- Del concepto 71002 al 71233: Títulos en unidades de inversión o en M.N. con tasa de interés real (distintos de UDIS) o en salarios mínimos.
- Del concepto 73002 al 73293: Títulos de deuda en moneda extranjera.
- Del concepto 74011 al 74233: Títulos con otro rendimiento (por ejemplo: en función de la variación del IPC, en función de la variación de un tipo de cambio, etc.).
- Del concepto 75002 al 75295: Títulos de deuda relativos a las inversiones del "fondo de reservas para pensiones del personal".
- Del concepto 76005 al 76225: Títulos de deuda emitidos por instituciones de banca múltiple que no revelen su nivel de riesgo.
- Del concepto 77002 al 79225: Certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios, de desarrollo e indizados

C) Seleccionando las posiciones de conformidad al grupo al que pertenezca el emisor del título o, en su caso, al numeral al que pertenezcan los valores emitidos por los Gobiernos de los Estados y Municipios, a saber:

VII. VALORES AVALADOS

Los valores garantizados (avalados) total o parcialmente computarán: la parte garantizada (avalada) en aquel grupo a que corresponda el garante (aval), y la parte no garantizada en el grupo a que corresponda el emisor.

Los valores garantizados total o parcialmente con los instrumentos derivados de las operaciones señaladas en la fracción I incisos a, b y d, fracciones II y III del artículo 46 de la L.I.C., computarán: la porción garantizada en el grupo RC-1 cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de la propia institución

y en el grupo RC-2 de la CUCB, según corresponda cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de otras instituciones, y la porción no garantizada en el grupo a que corresponda el emisor o acreditado.

VIII. MONTO A COMPUTAR

Una vez determinados los diferentes conceptos de la sección, conforme a las instrucciones anteriores, se obtendrá el monto a computar el cual será equivalente al importe positivo que resulte de restar, a las posiciones brutas largas, las correspondientes cifras de posiciones largas y cortas en el mismo título.

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 Y OTROS ACTIVOS.

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 y otros activos.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC08

Los conceptos de esta sección RC08 se refieren exclusivamente a operaciones de la Institución. Por ningún motivo deberán reportarse cifras que sean producto de la consolidación de estados financieros.

Los distintos conceptos, en su caso, deberán incluir los correspondientes intereses devengados, sumados al "principal".

En esta sección deberán incluirse los depósitos, créditos y demás activos, cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Institución.

Esta sección NO incluye:

- Compraventa al Contado de Valores: Ni los valores objeto de la operación, ni su contravalor.
- Compraventa al Contado de Divisas: Ni las divisas objeto de la operación, ni su contravalor.
- 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.
- Las inversiones (y cualquier financiamiento) en otros instrumentos de deuda 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 incluye exclusivamente en la sección RC09.
- Los financiamientos y cualquier otro tipo de aportación a título oneroso, cuyos recursos, directa o indirectamente, se destinen a la adquisición de acciones 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 entidades financieras filiales de todas éstas. Este tipo de financiamientos se incluye exclusivamente en la sección RC09.
- Las operaciones derivadas, reportos y préstamo de valores: Ni los subyacentes objeto de la operación, Ni sus correspondientes contravalores, premios, comisiones, cupones, etc.
- Los deudores por intereses devengados sobre inversiones en valores.
- Acciones (incluidas las inversiones en el patrimonio fijo, bajo cualquier modalidad de participación) de las bolsas de valores. Vigente a partir de febrero 2018
- Acciones de instituciones para el depósito de valores. Vigente a partir de febrero 2018

III. CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC08

La sección RC08 está conformada por los conceptos 80001 a 89803, en donde deberá reportarse la información, en una columna, tanto de las operaciones en moneda nacional, UDIS o moneda extranjera que realice la Casa de Bolsa en las oficinas en México y, sus agencias y/o sucursales (oficinas) en el exterior.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC08

Las operaciones que reporte la Casa de Bolsa relativas a sus subsidiarias y sucursales en el exterior, deberán clasificarse, sin excepción, desde la perspectiva de la Institución mexicana, como si hubieren sido celebradas por una oficina en México.

Las cifras de los conceptos 80001 al 83903, deberán reportarse en "promedio mensual de saldos diarios". Al efecto se sumarán los saldos de cada día del mes, considerando para los días inhábiles los saldos del día hábil inmediato anterior, y la suma se dividirá entre los días naturales del mes de que se trate.

Las cifras relativas a las otras partidas del activo e inversiones accionarias permanentes a que se refieren los conceptos 84303 a 89803, respectivamente, deberán reportarse con saldos al día último del mes de que se trate.

Al efecto, las operaciones a que se refieren los conceptos 80001 al 83903, denominadas en UDIS o en moneda extranjera, deberán valorizarse al "valor en pesos de la UDI" promedio del mes o al "tipo de cambio peso-dólar" promedio del mes, según corresponda, y las cifras de las operaciones a que se refieren los conceptos 84303 a 89803, denominadas en UDIS o en moneda extranjera, deberán 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, según corresponda.

Los conceptos relativos a créditos deberán incluir, en su caso: el principal vigente, el principal vencido, los intereses ordinarios devengados no cobrados y el refinanciamiento y capitalización de intereses. Asimismo dicha cartera deberá reportarse bruta, sin restarle las correspondientes reservas preventivas.

Las cifras de otras partidas distintas a la cartera de créditos, según sea el caso, deberán reportarse netas de los correspondientes castigos, depreciaciones y amortizaciones.

Según lo señalado en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB), en esta sección deberán incluirse en los conceptos 84502, 84503 y 89603, los depósitos y créditos, así como 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 la Casa de Bolsa esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dicho fondo para hacer frente a sus obligaciones. En el caso de las inversiones en acciones, en esta sección se reportarán exclusivamente aquéllas que no se consideran (restándolas) al determinar el Capital Neto.

V. ACLARACIONES DIVERSAS RELATIVAS A LA SECCIÓN RC08

Préstamos y Créditos Garantizados (avalados)

Los préstamos y créditos garantizados (avalados) así como las garantías contra-garantizadas computarán parcialmente: la parte garantizada en aquel grupo a que corresponda el garante (aval), y la parte no garantizada en el grupo a que corresponda el acreditado. En particular los préstamos y créditos garantizados total o parcialmente con los instrumentos derivados de las operaciones señaladas en la fracción I incisos a, b y d, fracciones II y III del Artículo 46 de la L.I.C., que no puedan ser retirados en fecha anterior a la fecha de vencimiento del crédito, computarán: 1) la porción garantizada, en el grupo RC-1 cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de la propia Institución (concepto 82521), y en el grupo RC-2 de la CUCB cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de otras Instituciones (concepto 82532) y en el grupo RC-2 con ponderación al 50% cuando la garantía se constituya en la propia institución o en Bancos Múltiples que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras (concepto 82535) y 2) la porción no garantizada, en el grupo a que corresponda el acreditado.

Inversiones Accionarias

No obstante que no están expuestas a riesgo de crédito, en esta sección deben reportarse las inversiones accionarias permanentes referidas en inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB (en los conceptos 89203 a 89603) así como las inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias cuya tenencia sea mayor al 15% del capital de la emisora (concepto 89803), las cuales tendrán una capitalización del 8%.

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC08

Concepto 80651: Depósitos en Banco de México

En este concepto deberán reportarse los depósitos de la Institución en el Banco de México.

Este concepto pondera al 0%, conforme a Grupo RC-1 de la CUCB

Concepto 80752: Depósitos en Bancos de Desarrollo

En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Institución haya realizado en Bancos de Desarrollo en las que, conforme a sus respectivas leyes orgánicas, el Gobierno Federal responda en todo tiempo por dichas operaciones.

Este concepto pondera al 0%, conforme a RC-1 de la CUCB. Concepto vigente a partir de septiembre 2017.

Concepto 81672: Depósitos en entidades financieras del exterior, filiales de la Institución o de las demás entidades financieras del grupo financiero

En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Casa de Bolsa haya realizado en entidades financieras del exterior, filiales de la Institución o de las demás entidades financieras del grupo.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 81722: Depósitos en bancos, con Alto Grado de Inversión, constituidos en los países comprendidos en el Grupo RC-1

En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Institución haya realizado en bancos, cuyos títulos estén calificados con Alto Grado de Inversión, constituidos en los países incluidos en RC-1 de la CUCB.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 81752: Financiamiento a Instituciones de Seguros constituidas en los países incluidos en el grupo RC-1, con Alto Grado de Inversión

En este concepto deberán reportarse los financiamientos a Instituciones de Seguros constituidas en los países incluidos en RC-1 de la CUCB, que estén calificadas con Alto Grado de Inversión.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 81813: Depósitos en otras instituciones financieras del exterior

En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Institución haya realizado en entidades financieras del exterior distintas a las mencionadas en los conceptos anteriores.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-3 de la CUCB.

Concepto 81912: Depósitos en entidades financieras del país, filiales de la propia Institución o integrantes del grupo financiero al que pertenezca la Institución o filiales financieras de todas éstas (Incluye Bancos Múltiples que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticias otorgada por agencias calificador de valores)

En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Institución haya realizado en las entidades financieras del país, filiales de la propia Institución o integrantes del grupo financiero al que pertenezca la Institución o filiales financieras de todas éstas incluidos los Bancos Múltiples que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticias otorgada agencias calificadora de valores.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Tratándose del reporte de entidades financieras filiales del exterior, este concepto incorpora los depósitos, de la filial de que se trate, a la matriz (la Casa de Bolsa).

Concepto 81945: Depósitos en Bancos Múltiples integrantes del grupo financiero al que pertenezcan, que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por Agencias Calificadora de Valores

En este concepto deberá reportarse el importe de los depósitos que la Casa de Bolsa haya realizado en Bancos Múltiples integrantes del grupo financiero al que pertenezca la Institución que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadora de valores.

Este concepto pondera al 50%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Tratándose del reporte de entidades financieras filiales del exterior, este concepto incorpora los depósitos de la filial de que se trate, a la matriz (la Casa de Bolsa).

Concepto 82112: Créditos y depósitos a Bancos Múltiples y Casas de Bolsa que no formen parte del grupo financiero al que pertenece la Casa de Bolsa, que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores.

En este concepto deberán reportarse los depósitos a cargo exclusivamente a Bancos Múltiples y Casas de Bolsa que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores (salvo que tales intermediarios pertenezcan al mismo grupo financiero de la propia Institución, en cuyo caso deberán informarse en el concepto 81912).

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 82302: Créditos a Fideicomisos Públicos constituidos por el Gobierno Federal.

En este concepto deberá reportarse el importe de los créditos a cargo de Fideicomisos Públicos constituidos por el Gobierno Federal para el fomento económico.

Este concepto pondera al 20%, RC-2 de las Disposiciones.

Concepto 82115 Créditos y depósitos a Bancos Múltiples y Casas de Bolsa, que no formen parte del grupo financiero al que pertenece la Casa de Bolsa , que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores.

En este concepto deberán reportarse los créditos a cargo de Bancos Múltiples y Casas de Bolsa que no formen parte del grupo financiero de la Casa y que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia otorgada por agencias calificadoras de valores. Los créditos y préstamos a cualquier otro tipo de intermediario financiero del país deberán reportarse en el concepto 82503, estén o no integrados a grupos financieros.

Este concepto pondera al 50%, RC-2 de las Disposiciones.

El importe de este concepto debe reportarse bruto sin restar las correspondientes reservas preventivas. Tales reservas deberán reportarse en los conceptos: 86178 y 86478, según corresponda.

Concepto 82412: Depósitos en Bancos de Desarrollo
En este concepto deberán reportarse los depósitos que la Institución haya realizado en Bancos de Desarrollo.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB. Concepto vigente hasta agosto 2017.

Concepto 82452: Créditos a Instituciones de Seguro Nacionales, con Alto Grado de Inversión

En este concepto deberá reportarse el importe de los créditos a Instituciones de Seguros autorizadas en México, calificadas con Alto Grado de Inversión.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 82503: Créditos a otras entidades financieras del País
En este concepto deberán reportarse los préstamos y créditos a entidades financieras del País distintas a las referidas en los conceptos 81912 a 82452.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-3 de la CUCB

Concepto 82521: Créditos garantizados con depósitos a cargo de la propia Institución o Bancos Múltiples que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia de agencias calificadoras).

En este concepto deberá reportarse la parte de los préstamos y créditos garantizados con los instrumentos relativos a las operaciones, siempre y cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de la propia Institución y estas no puedan ser retiradas en fecha anterior a la fecha de vencimiento del crédito.

La porción no garantizada deberá incluirse en el respectivo concepto considerando el grupo al que corresponda el acreditado.

Este concepto pondera al 20%, conforme a RC-1.

Concepto 82532: Créditos garantizados con depósitos a cargo de otras Instituciones o Bancos Múltiples que revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia de agencias calificadoras.

En este concepto deberá reportarse la parte de los préstamos y créditos garantizados con los instrumentos, siempre y cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de otras Instituciones y estas no puedan ser retiradas en fecha anterior a la fecha de vencimiento del crédito.

La porción no garantizada deberá incluirse en el respectivo concepto considerando el grupo al que corresponda el acreditado.

Este concepto pondera al 20%, RC-2 de la CUCB.

Concepto 82535: Créditos garantizados con depósitos a cargo de la propia Institución o con Bancos Múltiples que no revelen su nivel de riesgo conforme a la calidad crediticia de agencias calificadoras

En este concepto deberá reportarse la parte de los préstamos y créditos garantizados con los instrumentos relativos, siempre y cuando la garantía se constituya con pasivos a cargo de la propia Institución o con Bancos Múltiples que no revelen su nivel de Riesgo.

La porción no garantizada deberá incluirse en el respectivo concepto considerando el grupo al que corresponda el acreditado.

Este concepto pondera al 50%, conforme a RC-2 de la CUCB.

Concepto 83303: Otros Acreditados en moneda nacional

En este concepto deberá reportarse el monto de los créditos en moneda nacional distintos a los comprendidos en los conceptos anteriores.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-3 de la CUCB.

Concepto 83333: Otros créditos en moneda extranjera: para exportación, pre-exportación y a empresas generadoras de divisas

En este concepto deberá reportarse el importe de los créditos en moneda extranjera, para exportación y pre-exportación, así como los otorgados a empresas generadoras de divisas.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-2 e inciso f) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB.

Concepto 83806: Créditos en moneda extranjera otorgados a acreditados cuya moneda de la operación No sea la del país de residencia de la propia persona acreditada

Ejemplos: créditos en moneda extranjera a una empresa mexicana que no generen divisas; créditos en dólares a una empresa española que no genere divisas, etc.

Este concepto pondera al 112%, conforme a RC-3 e inciso f) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB.

Concepto 83903: Créditos en moneda extranjera otorgados a acreditados cuya moneda de la operación Sí sea la del país de residencia de la propia persona acreditada

Ejemplos: créditos en dólares a una empresa norteamericana.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-3 e inciso f) de la fracción I del Artículo 160 de la CUCB.

Concepto 84303: Otras Cuentas por Cobrar, excepto Deudores por liquidación de operaciones por inversiones en valores y compra venta de divisas y saldo a favor de impuestos e impuestos acreditables.

En este concepto deberá reportarse el saldo del rubro de Otras Cuentas por Cobrar, excepto las cuentas de Deudores por liquidación de operaciones por inversiones en valores y compra venta de divisas y de Saldo a favor de impuestos e impuestos acreditables.

Este concepto pondera al 100%, conforme a RC-3 de las Disposiciones.

Este concepto, de ser el caso, deberá reportarse neto de estimaciones o castigos.

Concepto 84311: Saldo a favor de impuestos e impuestos acreditables

En este concepto deberá reportarse el importe de la cuenta Saldo a favor de impuestos e impuestos acreditables.

Este concepto pondera al 0%, conforme a la CUCB.

Concepto 84403: Bienes adjudicados, excepto valores adjudicados

En este concepto deberán reportarse los bienes adjudicados, excepto los valores adjudicados, estos últimos que deberán informarse en las secciones RC05 o RC07, según correspondan.

Este concepto pondera al 100%, conforme a la CUCB.

Este concepto, de ser el caso, deberá reportarse neto de estimaciones, depreciaciones o castigos.

Concepto 84803: Inmuebles, mobiliario y equipo
En este concepto deberá reportarse el valor contable de los inmuebles, mobiliario y equipo (activo fijo) de la Institución.

Este concepto pondera al 100%, conforme a inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB.

Este concepto, de ser el caso, deberá reportarse neto de estimaciones, depreciaciones o castigos.

Concepto 84903: Cargos diferidos, pagos anticipados y demás partidas, que impliquen el diferimiento de la aplicación de gastos o costos en el capital de la Institución, que no se resten al determinar el capital básico

En este concepto deberán reportarse los cargos diferidos, pagos anticipados y demás partidas, con excepción de los impuestos diferidos activos, que impliquen el diferimiento de la aplicación de gastos o costos en el capital de la Institución y que no se resten al determinar el capital básico.

Este concepto pondera al 100%, conforme a inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB.

Concepto 84913: Impuestos diferidos activos, exclusivamente la parte que no se reste al determinar el capital básico

En este concepto deberán reportarse el importe total de los impuestos diferidos activos descontando el importe correspondiente que se haya restado al determinar el capital básico.

Este concepto pondera al 100%, conforme a inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB.

Concepto 84923: Deudores por liquidación de operaciones

En este concepto deberán reportarse el importe total de los deudores por liquidación de operaciones.

Este concepto pondera al 0%, conforme a la CUCB.

Concepto 84502: Depósitos y créditos relativos al fondo de reservas para pensiones y jubilaciones del personal, a personas comprendidas en RC-2 de las Disposiciones.

En este concepto deberá reportarse la parte de las inversiones realizadas por el "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", exclusivamente en depósitos y créditos a personas comprendidas en el grupo RC-2 de la CUCB. La parte relativa a títulos de deuda se deberá informar en la sección RC07.

Este concepto pondera al 20%, conforme a inciso 2.4 del Anexo 4 de la CUCB.

El importe de este concepto referente a créditos debe reportarse bruto, sin restar las correspondientes reservas preventivas.

Concepto 84503: Depósitos y créditos relativos al fondo de reservas para pensiones y jubilaciones del personal, a personas comprendidas en RC-3 de la CUCB.

En este concepto deberá reportarse la parte de las inversiones realizadas por el "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", exclusivamente en depósitos y créditos a

personas comprendidas en el grupo RC-3 de la CUCB. La parte relativa a títulos de deuda se deberá informar en la sección RC07.

Este concepto pondera al 100%, conforme a inciso 2.4 del Anexo 4 de la CUCB.

Concepto 89203: Acciones de Bolsas de Valores e Instituciones para el Depósito de Valores

En este concepto deberá reportarse el importe de las inversiones en las acciones y demás inversiones en el patrimonio fijo (capital), bajo cualquier modalidad de participación, de "Bolsas de Valores" e "Instituciones para el Depósito de Valores".

Las acciones deberán informarse a precios que se determinen conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

Este concepto pondera al 100%, y forma parte del grupo RC-3, conforme a inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB. Concepto vigente hasta enero 2018.

Concepto 89403: Acciones de Inmobiliarias Bancarias

En este concepto deberá reportarse el importe de las inversiones en acciones de inmobiliarias bancarias a que se refiere el Artículo 88 de la LIC.

Las acciones deberán informarse a precios que se determinen conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

Este concepto pondera al 100%, y forma parte del grupo RC-3, conforme a la CUCB.

Concepto 89503: Acciones de empresas de servicios complementarios y/o auxiliares en su administración

En este concepto deberá reportarse el importe de las inversiones en acciones de empresas de servicios complementarios y/o auxiliares en su administración, a que se refiere el Artículo 88 de la LIC.

Las acciones deberán informarse a precios que se determinen conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión.

Este concepto pondera al 100%, y forma parte del grupo o RC-3, conforme a inciso 2.6 del Anexo 4 de la CUCB.

Concepto 89603: Inversiones en acciones, efectuadas por el "fondo de reservas para pensiones del personal"

En este concepto deberá reportarse el importe de las inversiones en acciones que efectúe el fondo de reservas para pensiones del personal; la parte de éstas que no se reste al determinar el capital básico.

Este concepto aplica únicamente cuando la institución esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dicho fondo para hacer frente a sus obligaciones.

Las acciones deberán informarse a precios de mercado o, en su caso, conforme a los criterios de valuación establecidos por la Comisión. Este concepto pondera al 100%, y forma parte del grupo o RC-3, conforme inciso 2.4 del Anexo 4 de la CUCB.

Concepto 89803: Inversiones permanentes en acciones de empresas cotizadas (distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias) cuya tenencia sea mayor al 15% del capital de la emisora.

Valor razonable del total de las "acciones" de empresas cotizadas (distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias) cuya tenencia sea mayor al 15% del capital de la emisora.

Dichas inversiones deberán informarse valuadas conforme al método de participación, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Estas inversiones deberán reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto no deberán incluirse en los demás formatos.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 09

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC09 RELATIVA A LA INTEGRACIÓN DEL CAPITAL NETO O GLOBAL SEGÚN EL CASO.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC09

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para determinar el capital global de las Casas de Bolsa y sus filiales, conforme a lo establecido en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

II. DEFINICIONES DE LA SECCIÓN RC09

Para efectos de esta sección, se entenderá como:

- Valor contable o valor actualizado, al que se determine conforme a los criterios que en materia contable establece la CNBV, en su caso, neto de amortizaciones.
- Importe Actualizado, al valor contable al cierre del mes de que se trate (incluyendo, en su caso, el crédito mercantil y considerando el efecto, también en su caso, de las amortizaciones), de la operación a que se haga referencia.

III. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR

Cuando en esta sección y en las disposiciones se hace referencia a "entidades financieras del exterior" o a "entidades financieras del exterior filiales 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 las Casa de Bolsa mexicanas cuya matriz está ubicada en el exterior.

Las entidades financieras filiales del exterior de la Casa de Bolsa, 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.
- Las entidades financieras del exterior, son las que no son mexicanas.

IV. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC09

Se deben reportar las operaciones celebradas por la Casa de Bolsa en la República Mexicana y en sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. Se debe, también, reportar esta sección por separado, por cada una de sus entidades financieras del exterior filiales de la Casa de Bolsa.

V. CONCEPTOS Y COLUMNA DE LA SECCIÓN RC09

La sección RC09 está conformada por los conceptos 90075 al 94507, con una sola columna, en donde debe reportarse -en moneda nacional y conforme a los saldos contables- las cifras totales de la Casa de Bolsa, incluyendo los importes de agencias y sucursales en el exterior.

Tratándose del reporte que debe entregarse por cada entidad financiera filial del exterior filial de la Institución, se procederá en los mismos términos del párrafo anterior.

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.

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

VII. INVERSIONES

En el apartado relativo a inversiones (91950 a 92810) deben incluirse, según correspondan y conforme a la CUCB:

- Las inversiones del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", cuando la Casa de Bolsa esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dichos fondos para hacer frente a sus obligaciones.
- Las acciones y títulos cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Casa de Bolsa, y
- De la parte correspondiente a las acciones distintas al capital fijo, las inversiones, provenientes de la desagregación que se haga en sus diversas posiciones individuales, del portafolio de las sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, No cotizadas.

AYUDAS ESPECÍFICAS DE LA SECCIÓN RC09

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 global de las Casas de Bolsa y sus filiales (subsidiarias), conforme a lo establecido en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

II. DEFINICIONES DE LA SECCIÓN RC09

Para efectos de esta sección, se entenderá como:

- Valor contable o valor actualizado, al que se determine conforme a los criterios que en materia contable establece la CNBV, en su caso, neto de amortizaciones.
- Importe Actualizado, al valor contable al cierre del mes de que se trate (incluyendo, en su caso, el crédito mercantil y considerando el efecto, también en su caso, de las amortizaciones), de la operación a que se haga referencia.

III. ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR

Cuando en esta sección y en las disposiciones se hace referencia a "entidades financieras del exterior" o a "entidades financieras del exterior filiales de la Institución" (subsidiarias), debe entenderse que se trata de una institución no mexicana y, por lo tanto, NO debe entenderse como una referencia hecha a las Casa de Bolsa mexicanas cuya matriz está ubicada en el exterior.

Las entidades financieras filiales del exterior (subsidiarias) de la Casa de Bolsa, 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.
- 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 Casa de Bolsa en la República Mexicana y en sus Agencias y Sucursales en el Extranjero. Se debe, también, reportar esta sección por separado, por cada una de sus entidades financieras del exterior filiales (subsidiarias) de la Casa de Bolsa.

V. CONCEPTOS Y COLUMNA DE LA SECCIÓN RC09

La sección RC09 está conformada por los conceptos 90075 al 94507, con una sola columna, en donde debe reportarse -en moneda nacional y conforme a los saldos contables- las cifras totales de la Casa de Bolsa, incluyendo los importes de agencias y sucursales en el exterior.

Tratándose del reporte que debe entregarse por cada entidad financiera filial del exterior de la Institución (subsidiaria), se procederá en los mismos términos del párrafo anterior.

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.

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

VII. INVERSIONES

En el apartado relativo a inversiones (91950 a 92810) deben incluirse, según correspondan y conforme a la CUCB:

- Las inversiones del "fondo de reservas para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal", cuando la Casa de Bolsa esté obligada a realizar aportaciones adicionales en caso de que existan faltantes en dichos fondos para hacer frente a sus obligaciones.
- Las acciones y títulos cedidos en garantía, cuyos derechos de propiedad correspondan a la Casa de Bolsa, y
- De la parte correspondiente a las acciones distintas al capital fijo, las inversiones, provenientes de la desagregación que se haga en sus diversas posiciones individuales, del portafolio de las sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, No cotizadas.

VIII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC09

Concepto 90075: Capital contable

En este concepto debe reportarse el importe del capital contable de la Casa de Bolsa, al cierre del mes de que se trate, antes de cualquier proceso de consolidación de sus estados financieros, con los estados financieros de las entidades financieras filiales (subsidiarias) de la Casa de Bolsa.

Este concepto es informativo.

Concepto 90080: Capital contable sin obligaciones subordinadas y sin instrumentos de capitalización bancaria

En este concepto debe reportarse el importe del capital contable de la Casa de Bolsa, al cierre del mes de que se trate, antes de cualquier proceso de consolidación de sus estados financieros, con los estados financieros de las entidades financieras filiales (subsidiarias) de la Casa de Bolsa, sin incluir a las Obligaciones Subordinadas que, en su caso, estén contabilizados en cuentas de capital.

Se parte de este concepto para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 90095: Aportaciones de capital ya realizadas, pendientes de formalizar

En este concepto debe reportarse el importe de las "Aportaciones al capital de la Casa de Bolsa ya efectuadas, que se encuentren pendientes de formalizar". No deben incluirse aquellas aportaciones que por cualquier motivo ya se encuentren incorporadas al capital contable.

Este concepto es informativo.

Concepto 91005: Obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa, computables como capital básico No Fundamental

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, computables como capital básico No Fundamental, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

Estas obligaciones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Lo reportado en este concepto será un monto no mayor al quince por ciento de la cantidad positiva que resulte de restar al importe del capital contable, el importe de la suma de los conceptos referidos en los incisos b) a i) de la fracción I del artículo 162 Bis de la CUCB para considerarse como capital básico no fundamental.

Concepto 91010: Obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa computables como capital complementario

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

El importe corresponderá a la parte que excede el límite a que se refiere la fracción II del artículo 162 Bis.

En todo caso estas obligaciones computarán como complementario en un monto que sumado al importe de los conceptos 90660 y 90670 no exceda el 50 por ciento de la parte básica.

Concepto 91015: Obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, No computables como capital

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUB, valuadas conforme a criterios de la CNBV que no computan como capital por exceder el límite de computabilidad del capital básico no fundamental o complementario.

Este concepto es Informativo.

Concepto 90660: Obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que no cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, computables como Capital Complementario

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que no cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, computables como capital complementario, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

Este concepto se suma para integrar el Capital Complementario.

En todo caso estas obligaciones computarán como complementario en un monto que sumado al importe de los conceptos 91010 y 90670 no exceda el 50 por ciento de la parte básica.

Concepto 90665: Obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que no cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, No computables como capital

Se deben reportar el importe de obligaciones subordinadas de conversión obligatoria en títulos representativos del capital social de la casa de bolsa que no cumplen con los criterios del artículo 163 de la CUCB, No computables como capital, por exceder el límite de computabilidad del capital complementario.

Este concepto es Informativo.

Concepto 90670: Obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria, computables como capital complementario

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria, computables como capital complementario, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

Este concepto se suma para integrar el Capital Complementario.

En todo caso estas obligaciones computarán como complementario en un monto que sumado al importe de los conceptos 91010 y 90660 no exceda el 50 por ciento de la parte básica.

Concepto 90675: Obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria, No computables como capital

Se debe reportar el importe de obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria, *No computables como capital*, por exceder el límite de computabilidad del capital complementario.

Este concepto es Informativo.

Concepto 91950: Inversiones en obligaciones subordinadas emitidas por otros intermediarios y por sociedades controladoras de grupos financieros

Suma de los conceptos 92000 y 92050.

Concepto 92000: Inversiones en obligaciones subordinadas de conversión obligatorias emitida por otros intermediarios y por sociedades controladoras de grupos financieros

Se deben reportar las inversiones en obligaciones subordinadas de conversión obligatoria a capital emitidas por otras entidades financieras o por controladoras de grupos financieros, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

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 92050: Inversiones en obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria, emitidas por otros intermediarios y por sociedades controladoras de grupos financieros

Se deben reportar las inversiones en obligaciones subordinadas no convertibles y de conversión voluntaria a capital, emitidas por otras entidades financieras o por controladoras de grupos financieros, valuadas conforme a criterios de la CNBV.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Estas inversiones deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto no deben incluirse las demás secciones del formulario.

Concepto 92071: Instrumentos de deuda subordinada, relativos a esquemas de bursatilización

Suma de los conceptos 92075 y 92079.

Concepto 92075: Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, relativos a esquemas de bursatilización de hipotecas

En este concepto deben reportarse las inversiones en instrumentos de deuda subordinada relativos a esquemas de bursatilización de hipotecas, conforme a lo indicado en la CUCB.

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 92079: Instrumentos de deuda subordinada, relativos a esquemas de bursatilización de otras carteras (distintas a hipotecas)

En este concepto deben reportarse las inversiones en instrumentos de deuda subordinada relativos a esquemas de bursatilización de otras carteras (distintas de hipotecas), valuados conforme a los criterios de la CNBV.

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 92100: Inversiones en otros instrumentos de deuda subordinada

En este concepto deben reportarse las inversiones (y cualquier financiamiento) en otros instrumentos de deuda subordinados distintos a los señalados en los conceptos 92000, 92050, 92075 y 92079, valuados conforme a criterios de la CNBV. Este concepto incorpora el importe de cualquier financiamiento (depósitos, valores, créditos, etc.), cuyo pago por parte del depositario, emisor o deudor, según se trate, esté previsto que se efectúe, por haberlo así convenido, después de cubrir otros pasivos.

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 92140: Inversiones en acciones de entidades financieras y controladoras

Suma de los conceptos 92150, 92200, 92250, 92300 y 92350.

Concepto 92150: Inversiones en acciones del capital fijo de sociedades y fondos de inversión

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, directas e indirectas, en el capital fijo de sociedades de inversión y en el capital fijo (o instrumentos de participación equivalente) de fondos de inversión; sean o no filiales (subsidiarias) de la Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

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 92200: Inversiones en acciones de controladoras de grupos financieros

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, directas e indirectas, 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, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

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 92250: Inversiones en acciones de entidades financieras del país

Suma de los conceptos 92255 y 92260.

Concepto 92255: 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, directas e indirectas, 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, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

El cálculo debe realizarse individualmente por cada subsidiaria o NO subsidiaria y conforme a lo ya indicado.

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 92260: Inversiones en acciones de otras entidades financieras

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, directas e indirectas, en acciones de cualquier entidad financiera del país (excepto las relativas a las entidades financieras a que se refieren los conceptos 92150, 92200 y 92255), subsidiaria o no subsidiaria, y del grupo y no del grupo, inclusive en acciones de la propia Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

El cálculo debe realizarse individualmente por cada subsidiaria o cada NO subsidiaria y conforme a lo ya indicado.

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 92300: Inversiones en acciones de entidades financieras del exterior

Suma de los conceptos 92305 y 92310.

Concepto 92305: Inversiones directas en acciones de entidades financieras del exterior

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones directas, en el capital de entidades financieras del exterior, subsidiaria, o no subsidiaria de la Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, 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 (subsidiarias), ya que todas las inversiones "piramidadas", una a una, las debe reportar la institución matriz (el banco múltiple).

El cálculo debe realizarse individualmente por cada subsidiaria o cada NO subsidiaria y conforme a lo ya indicado.

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 92310: Inversiones indirectas en acciones de entidades financieras del exterior

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones "Indirectas" (realizadas a través de Entidades Financieras o Controladoras, filiales directas de la Institución), en el capital de entidades financieras del exterior, subsidiaria y NO subsidiaria de la Institución, así como las inversiones que éstas últimas directa o indirectamente efectúen en otras entidades financieras del exterior, en controladoras de grupos financieros y en entidades financieras del país.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al método de participación, incluyendo el crédito mercantil neto de amortizaciones, o a otro valor contable, según el criterio de la CNBV que corresponda.

Al efecto se considerarán una a una, dichas inversiones, sin perjuicio de que el capital de alguna de ellas provenga, directamente, a su vez de otra entidad financiera.

Este concepto caso 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 (la Casa de Bolsa).

El cálculo debe realizarse individualmente por cada subsidiaria o cada NO subsidiaria y conforme a lo ya indicado.

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 92350: Cámaras de compensación o fideicomisos o figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar operaciones celebradas en bolsa

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones o aportaciones efectuadas, directa o indirectamente, en el capital de empresas o 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 de la Institución.

Dichas inversiones deben informarse valuadas conforme al correspondiente criterio de la CNBV.

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 92360: Entidades financieras filiales sujetas a requerimiento de capital

En este concepto debe reportarse la suma de los importes positivos que resulten de restar, al máximo de los capitales regulatorios requeridos por la autoridad a la entidad financiera filial de que se trate, el valor contable de la inversión accionaria en la propia entidad financiera filial de que se trate.

El cálculo debe realizarse individualmente por cada filial 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, previamente a la determinación del importe positivo correspondiente, debe ponderarse el máximo de los capitales regulatorios por la participación accionaria en la entidad financiera filial.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92375 Inversiones en acciones de 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 estas

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones, directas o indirectas, en acciones cotizadas y no cotizadas 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 92710: Inversiones permanentes en acciones de empresas no cotizadas distintas a las de empresas que les presten servicios o complementarias, cuyo monto exceda del quince por ciento del capital de la respectiva emisora

En este concepto debe reportarse el importe actualizado, incluyendo los efectos de valuación por el método de participación, de las inversiones en el capital de empresas distintas a las empresas que les presten servicios complementarios, siempre y cuando no se encuentren cotizados en la Bolsa Mexicana de Valores o alguna otra reconocida por autoridades financieras cuyo monto exceda del 15 por ciento del capital de la emisora. Cuando tales acciones se mantengan en posición propia por un período mayor a seis meses.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 92790: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas, respecto de las cuales la Institución tenga hasta por el 15% del total de las acciones de la sociedad de que se trate sin considerar las relativas al capital fijo. Dicho importe actualizado debe comprender exclusivamente la parte proporcional de la sociedad invertida en acciones, ponderado por la participación de la Casa de Bolsa que no corresponda al capital fijo.

Este concepto es informativo.

Considerando que estas inversiones no se restan para integrar el Capital Fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC05 relativa a operaciones con acciones y sobre acciones.

Concepto 92792: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas.

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las inversiones en acciones, distintas a las del capital fijo, de sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas, respecto de las cuales la Institución tenga más del 15% del total de las acciones de la sociedad de inversión de que se trate sin considerar las relativas al Capital Fijo. Dicho importe actualizado debe comprender exclusivamente la parte proporcional de la sociedad 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 92795: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas y no cotizadas, 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 sociedades de inversión tanto de capitales como de objeto limitado, cotizadas y no cotizadas, cualquiera que sea el porcentaje de participación de la Institución. Dicho importe actualizado debe comprender exclusivamente la parte proporcional de la sociedad invertida en instrumentos de deuda, 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 Fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC01 o RC03 o RC04 o RC07, según corresponda.

Concepto 92808: Inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión de renta variable, 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 sociedades de inversión de renta variable, cualquiera que sea su porcentaje de participación.

Este concepto es informativo.

Considerando que estas inversiones no se restan 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 sociedades de inversión de instrumentos de deuda, 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 sociedades de inversión de instrumentos de deuda, cualquiera que sea el porcentaje de participación de la Casa de Bolsa.

Este concepto es informativo.

Considerando que estas inversiones no se restan para integrar el Capital Fundamental, su importe debe incluirse también en la sección RC01 o RC03 o RC04 o RC07, según corresponda.

Concepto 92950: Financiamiento y cualquier aportación para adquisición de acciones de la propia Casa de Bolsa, del grupo financiero, de las demás entidades integrantes del grupo financiero o de las filiales financieras de todas las anteriores

En este concepto debe reportarse el importe de los financiamientos (valores, préstamos y créditos) y cualquier tipo de aportación a título oneroso, cuyos recursos, directa o indirectamente, se destinen a la adquisición de acciones de la propia Casa de Bolsa, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Casa de Bolsa o de las filiales financieras de todas las anteriores.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Estos financiamientos deben reportarse exclusivamente en la presente sección, por lo tanto no deben incluirse en las demás secciones del formulario.

Concepto 93500: ISR y PTU, diferidos Activos

Suma de los conceptos 93510 y 93520.

Concepto 93510: ISR diferido activo, proveniente de pérdidas fiscales

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los Impuestos Diferidos Activos Provenientes de Pérdidas Fiscales por cualquier concepto.

Este concepto se resta para integrar el Fundamental.

Concepto 93520: ISR diferido activo, proveniente de constitución de reservas en exceso al límite fiscal

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los Impuestos Diferidos Activos Provenientes de la Constitución de Reservas en Exceso del Límite Fiscal.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 93700: 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

Suma de los conceptos: 93720, 93730 y 93750.

Concepto 93720: Intangibles de cualquier tipo

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de los "Intangibles", de cualquier tipo.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Concepto 93730: Crédito Mercantil

Suma de los conceptos: 93733 y 93736.

Concepto 93733: Crédito mercantil relativo a las inversiones en acciones 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 que se restan para determinar el Capital Fundamental.

Este concepto es informativo, considerando que el Crédito Mercantil correspondiente a dichas inversiones debe reportarse, en el concepto de que se trate, formando parte del importe de las acciones que se restan al integrar el Capital Fundamental.

Concepto 93736: Crédito mercantil relativo a las inversiones en acciones distintas a las que se resten para determinar el capital básico

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.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

Lo solicitado en este concepto es sin perjuicio de que dicho Crédito Mercantil, en el monto que corresponda, también se debe reportar en esta sección, en el concepto de que se trate (del 92140 al 92810), formando parte del importe de las acciones que no se restan al determinar el Capital Fundamental.

Concepto 93750: Erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo

Suma de los conceptos: 93755 y 93758.

Concepto 93755: Erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, relativos a los activos fijos y a los pagos anticipados 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, relativos a los activos fijos y a los pagos anticipados en no más de un año.

Este concepto es informativo.

Concepto 93758: Otras erogaciones o gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo

En este concepto debe reportarse el importe actualizado de las Erogaciones o Gastos cuyo reconocimiento en el capital contable se difiera en el tiempo, relativos a cualquier partida que no corresponda a los activos fijos y a los pagos anticipados en más de un año.

Este concepto se resta 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 aplicables, por ejemplo: créditos relacionados en exceso al límite legal; realizar operaciones de derivados sin contar con la autorización correspondiente de la autoridad; otorgar créditos o contratar pasivos en condiciones fuera de mercado, etc.

Este concepto se resta para integrar el Capital Fundamental.

El importe de las operaciones que se reporten en este concepto no debe incluirse en las demás secciones del formulario.

Convalidación del cómputo.- A continuación deben informar, para fines de convalidar su índice de capital y principales componentes del capital, los siguientes conceptos:

Concepto 94501: Capital Fundamental sin Impuestos Diferidos Activos y sin Obligaciones Subordinadas (Instrumentos de capitalización bancaria)

En este concepto debe reportarse el importe resultante de sumar o restar, según sea el caso, los siguientes conceptos:

90080

II) menos suma (91950+92071+92100)

III) menos suma (92150+92200+92255+92260+92305+92310+92350+92360)

IV) menos suma (92375+92710+92792)

V) menos 92950

VI) menos suma (93720+93736+93758)

Concepto 94502 Capital Fundamental

Parte básica del capital neto a que se refiere la fracción I del artículo 162 Bis de la CUCB.

En este concepto debe reportarse el importe resultante de sumar los siguientes conceptos:

94501

Menos

VII) máx. (0, (93510+93520) - [I - (II a VI)]*10%))

VIII) 93910

Concepto 94503 Capital Básico No Fundamental

Parte básica del capital neto a que se refiere la fracción II del artículo 162 Bis de la CUCB.

máx (0, Mín(91005, [I - suma(II a VIII)] *15%))

Concepto 94150: Capital Básico

En este concepto debe reportarse el importe resultante de sumar los siguientes conceptos:

94502 + 94503

Concepto 94200: Capital Complementario

En este concepto debe reportarse la parte del importe resultante de sumar los conceptos de obligaciones subordinadas que computan como complementario, que no exceda del 100% del concepto 94150, es decir:

Máx(0, Mín([91010+90660+90670] , 50% CB))

Concepto 94504: Capital Neto

En este concepto deberá reportarse el importe resultante de sumar el Capital Básico que a su vez se conforma del Capital Fundamental 94502 y el Capital Básico no Fundamental 94503 y Complementario 94200.

Concepto 94300: Índice de Capital (considerando el Capital Neto)

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 94505 Coeficiente de Capital Básico.

En este concepto deben reportar el resultado de dividir el capital básico conforme al artículo 162 Bis de la CUCB entre los activos ponderados sujetos a riesgo totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

Concepto 94506 Coeficiente de Capital Fundamental

En este concepto deben reportar el resultado de dividir el capital fundamental conforme a la fracción I del artículo 162 Bis de la CUCB entre los activos ponderados sujetos a riesgo totales, expresado en porcentaje redondeado a la centésima de punto porcentual más cercana.

Concepto 94507 Suplemento de Capital

Deben indicar si mantienen un suplemento de capital equivalente al 2.5 % de los Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales adicional a los mínimos establecidos en el artículo 162 bis de la CUCB, los valores a registrar son 1000= si se mantiene suplemento de capital , 2000= no se mantiene suplemento de capital.

La información contenida en este concepto será validada por Banco de México.

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". Este concepto es informativo.

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; bienes a recibir en garantía (con transferencia de propiedad) y otras operaciones activas y pasivas que sean objeto de una tasa de rendimiento referida al S.M.G.

II. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC11

La sección RC11 está conformada por los conceptos 110300 al 118806, 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 "sociedades de inversión" (a que se refiere la Ley de Sociedades de Inversión), derivadas de la cartera de valores integrante de los activos y, en su caso, pasivos de dichas sociedades 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 y otras figuras similares, 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 de la sociedad o fondo de inversión, determinando el monto en función de la proporción de tenencia de acciones, de la sociedad o fondo de inversión de que se trate, respecto de las acciones totales de la misma (fracción X del Artículo 151 de la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

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 la CUCB, 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
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

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.

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 (el Art. 152, fracción I de la CUCB) 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.

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.

C) Tratándose de operaciones a tasa fija con cupones a tasa fija e instrumentos derivados que generen posiciones equivalentes a títulos a tasa fija, el plazo del instrumento, 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 2 de la CUCB.

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 haya más revisiones o ajustes de tasa posteriores.

Debe considerarse que el término "del plazo" del título, 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.

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 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.

VI. SUBSECCIONES Y APARTADOS DE LA SECCIÓN RC11

Considerando el procedimiento establecido en las Disposiciones 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 115826), 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 Disposiciones sean objeto de compensación total con otras de naturaleza contraria.
- La segunda (del concepto 116180 al 118806), 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 la fracción II del Artículo 152 de la CUCB, y de lo señalado en la instrucción VI I 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 la fracción II del Artículo 152 de la CUCB según aplique, que a la letra establece:

"(*fracción II del Artículo 152 de la CUCB)* 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 (*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, 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 (*frac. VII del Art. 151)*, con títulos de deuda de tasa de interés fija.

c) Los contratos adelantados y los futuros comprendidos en (*frac. VIII del Art. 151)*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 (*frac. I del Art. 152)*

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 la CUCB, 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 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.

C) El importe a compensar es independiente al importe de las operaciones.

D) Conforme a lo anterior, no podrán compensarse títulos o instrumentos que no sean de la misma naturaleza.

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).

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.

X. VALUACIÓN DE LAS OPERACIONES

Las operaciones, o cada parte de las mismas, según se trate, deberán informarse al valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB y su anexo 11.

Tratándose de opciones o títulos opcionales, se considerará como "valor delta", al resultado de multiplicar el valor de los títulos o instrumentos subyacentes que conforme al criterio que en materia contable establezca la CUB, por el número de títulos o instrumentos subyacentes que ampare la opción por la "delta" de la opción. La "delta" será, para el caso de opciones listadas, la que publique el mercado en donde éstas se coticen y para el caso de que no sea publicada o que se trate de opciones no listadas, la "delta" a utilizar será la que determine la propia casa de bolsa en su modelo de valuación.

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.

XII. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CADA CONCEPTO DE LA SECCIÓN RC11

I.- Conceptos relativos a activos brutos

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 pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) al cierre del mes de que se trate. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. 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 pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestatario. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. 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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportador.

El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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).

Conceptos 110500 – 110526: Valores a recibir por préstamos de títulos, actuando como prestamista

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por préstamos de títulos actuando como prestamista, deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a recibir, por reportos actuando como reportado.

Estos conceptos NO aplican 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 incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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 deben reportar el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte activa de contratos adelantados de compra relativa a 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 112830 – 112856: Emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 112860 – 112886: Tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a recibir por la tenencia de opciones de venta de subyacentes referidos al S.M.G.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la Casa de Bolsa el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 112890 – 112916: Subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 112920 – 112946: Subyacente a recibir por de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. – fase activa

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a recibir por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G.

Deben incluir 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB. De dichos derivados, debe reportarse la parte activa relativa a subyacentes referidos al S.M.G.

Conceptos 112800– 112826: Otras operaciones activas que sean objeto de un rendimiento referido a S.M.G. en moneda nacional

En estos conceptos deben incluir, cualquier otra operación, realizada por la casa de bolsa o su filial, que sea objeto del cobro de un rendimiento referido al S.M.G. no incluida en cualquiera de los demás conceptos de activos brutos.

II.- Conceptos relativos a pasivos brutos

Conceptos 113250 – 113276: Instrumentos de captación a plazo

En estos conceptos deben incluirse los instrumentos de captación a plazo (certificados bursátiles, obligaciones subordinadas no convertibles o de conversión voluntaria, 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB (principal e intereses devengados no pagados).

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 pendientes de liquidar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas). El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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 pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como prestamista. El importe de dichos títulos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB. 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

En estos conceptos deben incluir los títulos de deuda a entregar, por reportos pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas), actuando como reportado.

El importe de los títulos a entregar debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

Estos conceptos NO aplican 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 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 incluir los títulos de deuda a entregar, por préstamos de títulos actuando como prestatario.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes. El importe de los títulos respectivos debe corresponder a su valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB.

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

En estos conceptos deben incluir el valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de los títulos a entregar, por reportos de valores actuando como reportador.

En estos conceptos deben incluir todas las operaciones vigentes al cierre de mes de que se trate, incluyendo las pendientes de iniciar (fecha valor 24, 48, 72 y 96 horas) a dicho cierre de mes.

Estos conceptos NO aplican 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 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB 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 115850 – 115876: Subyacente a entregar Emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos S.M.G. fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la parte relativa al subyacente a entregar por emisión de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 115880 – 115906: Subyacente a entregar de Tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. – fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" valor conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al subyacente a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir todas las operaciones "dentro del dinero" y queda a elección de la institución el incluir o no las operaciones "fuera del dinero".

Conceptos 115910 – 115936: Emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G. – fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el "valor delta" de la moneda nacional a entregar, por emisión de opciones y títulos opcionales de venta de subyacentes referidos al S.M.G.

Sin excepción deben incluir todas las operaciones.

Conceptos 115940 – 115966: Tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G. – fase pasiva

En estos conceptos deben reportar el "valor "delta" de la moneda nacional a entregar, por tenencia de opciones y títulos opcionales de compra de subyacentes referidos al S.M.G.

En lo relativo a la tenencia de opciones deben incluir 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa al contrato principal de operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB, 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 conforme al criterio que en materia contable establezca la CUCB de la parte relativa a los instrumentos derivados implícitos en operaciones estructuradas, a las que se refiere la fracción IX del Artículo 151 de la CUCB. De dichos derivados, debe reportarse la parte pasiva de los mismos.

Conceptos 115800 – 115826: Otras operaciones pasivas cuyo rendimiento esté referido al S.M.G

En estos conceptos deben incluir, cualquier operación realizada por la casa de bolsa o su filial que sea objeto del pago de un rendimiento referido a S.M.G. no incluida en cualquiera de los demás conceptos de pasivos brutos.

Requerimientos de Capitalización (RC) Sección 12

INSTRUCCIONES Y/O CONSIDERACIONES PARA EL LLENADO DE LA SECCIÓN RC12 RELATIVA AL RIESGO OPERACIONAL.

I. OBJETIVO DE LA SECCIÓN RC12

Esta sección tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para calcular el requerimiento de capital por riesgo operacional.

II. COBERTURA DE LA SECCIÓN RC12

Los conceptos de esta sección RC12 se refieren exclusivamente a operaciones de la Institución sin considerar su respectiva actualización derivada de la aplicación de los efectos inflacionarios (Boletín B-10).

En esta sección deberán incluirse los ingresos y gastos por, comisiones y tarifas, resultados por compraventa de valores, divisas y metales, ingresos y rendimientos por intereses, gastos por intereses, coberturas por seguros, así como las reservas constituidas y las demás partidas indicadas en la Circular Única de Casas de Bolsa (CUCB).

III. CONCEPTOS Y COLUMNAS DE LA SECCIÓN RC12

La sección RC12 está conformada por los conceptos 125010 a 128200, con una sola columna en donde deberá reportarse, la información tanto de sus oficinas en México, como de sus agencias y sucursales (oficinas) en el exterior.

IV. CIFRAS A REPORTAR EN LA SECCIÓN RC12

Las cifras de los conceptos deberán reportarse con saldos acumulados al día último del mes inmediato anterior al mes que se esté computando, salvo el importe relativo al concepto 128010 y 128200 que deberá informarse conforme a lo señalado en la ayuda específica de este concepto.

Para el cálculo del requerimiento de capital por este tipo de riesgo, el flujo mensual correspondiente al mes t se calculara restando al saldo acumulado del mes t el saldo acumulado del mes t-1.

La información de esta sección deberá 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, deberán 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.

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

VI. INSTRUCCIONES (AYUDAS) ESPECÍFICAS PARA EL LLENADO DE CONCEPTOS DE LA SECCIÓN RC12

En los conceptos del 125010 al 125090 deben reportar los ingresos procedentes de comisiones y tarifas por:

Concepto 125010: Compra Venta de Valores.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 530400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125020: Actividades Fiduciarias.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 530800000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125030: Custodia o Administración de bienes.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 531500000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125040: Ofertas Públicas.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 532200000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125050: Operaciones con Oro y Plata

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 532300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125060: Intermediación Financiera

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 532400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125070: Operaciones con Sociedades de Inversión.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 532500000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125080: Otras Comisiones y Tarifas.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 539000000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125090: Ingresos por Asesoría Financiera.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 515001000000 del catálogo mínimo.

En los conceptos del 125510 al 125580 deben reportar los gastos procedentes de comisiones y tarifas por:

Concepto 125510: Compra Venta de Valores.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125520: Transferencia de Fondos.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630200000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125530: Prestamos Recibidos.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125540: Colocación de Deuda.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 631100000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125550: La Bolsa Mexicana de Valores.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630500000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125560: Intermediarios Financieros

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630600000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125570: El Indeval.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 630700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 125580: Otras Comisiones y Tarifas.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 639000000000 del catálogo mínimo.

En los conceptos del 126011 al 126770 deben reportar los importes relativos a utilidad, pérdida, ingresos o gastos por intermediación:

Concepto 126011: Utilidades por compraventa de valores e instrumentos derivados.

En este concepto no se reportarán saldos netos, sólo incluye utilidades brutas. Al importe de este concepto se le restará el importe del concepto 126110 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la suma de las cuentas 590100000000 + 590200000000 + 590300000000 + 590400000000 + 590500000000 + 590900000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126012: Utilidad por la venta de títulos conservados a vencimiento y/o de los disponibles para la venta.

En este concepto no se reportarán saldos netos, sólo incluye utilidades brutas.

Al importe de este concepto se le restará el importe del concepto 126112 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 590300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126050: Utilidad por compraventa de divisas.

En este concepto no se reportarán saldos netos, sólo incluye utilidades brutas. Al importe de este concepto se le restará el importe del concepto 126150 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 590600000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126070: Utilidad por compraventa de metales.

En este concepto no se reportarán saldos netos, sólo incluye utilidades brutas. Al importe de este concepto se le restará el importe del concepto 126170 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 590700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126110: Pérdidas por compraventa de valores e instrumentos derivados.

En este concepto no se reportan saldos netos, sólo incluye pérdidas brutas.

El importe de este concepto se restará al importe del concepto 126011 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la suma de las cuentas 690100000000 + 690200000000 + 690300000000 + 690400000000 + 690500000000 + 690900000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126112: Pérdidas por la venta de títulos conservados a vencimiento y/o de los disponibles para la venta.

En este concepto no se reportan saldos netos, sólo incluye pérdidas brutas.

El importe de este concepto se restará al importe del concepto 126012 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 690300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126150: Pérdidas por compraventa de divisas.

En este concepto no se reportan saldos netos, sólo incluye pérdidas brutas.

El importe de este concepto se restará al importe del concepto 126050 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 690600000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126170: Pérdidas por compraventa de metales.

En este concepto no se reportan saldos netos, sólo incluye pérdidas brutas.

El importe de este concepto se restará al importe del concepto 126070 al determinar el requerimiento de capital por riesgo operacional.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 690700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126510: Ingresos por intereses por disponibilidades.

En este concepto deberán reportarse tanto los intereses cobrados como los devengados no cobrados por los depósitos en bancos y demás disponibilidades.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 510100000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126515: Intereses y rendimientos a favor provenientes de cuentas de margen.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 511200000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126520: Ingresos por intereses y rendimientos a favor provenientes de inversiones en valores.

En este concepto deberá 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.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 510300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126530: Ingresos por intereses y rendimientos a favor en operaciones de reporto.

En este concepto deberá reportarse el importe de los intereses y rendimientos cobrados, así como los devengados no cobrados por inversiones relativas a operaciones de reporto.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 510400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126540: Premios a Favor en operaciones de Préstamo de Valores.

En este concepto deberá reportarse el importe de los premios a favor cobrados, así como los devengados no cobrados por operaciones de préstamo de valores.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 510700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126550: Ingresos por prima por colocación de deuda.

En este concepto deberá reportarse el importe de los primas a favor cobrados, así como los devengadas no cobrados por operaciones de colocación de deuda.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 511100000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126560: Cuenta de ajuste para cuenta de Gastos por Intereses con Saldos Negativos.

En este concepto deberá reportarse la suma del valor absoluto del saldo negativo perteneciente a cuales quiera de los conceptos de gastos por intereses.

Para efectos del cómputo de capitalización, el importe de este concepto se sumará al importe 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 restará del importe de los conceptos correspondientes a Gastos por intereses.

Concepto 126570: Dividendos de instrumentos de patrimonio neto.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 511800000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126705: Intereses por Pasivos Bursátiles.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 611300000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126710: Gastos por intereses en préstamos bancarios y otros organismos.

En este concepto deberá reportarse el importe de intereses pagados, así como los devengados no pagados por préstamos interbancarios y de otros organismos.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 611400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126720: Gastos por intereses por obligaciones subordinadas.

En este concepto deberá reportarse el importe de los intereses a cargo pagados y los devengados no pagados derivados de obligaciones subordinadas de cualquier tipo.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 610600000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126730: Gastos por intereses y rendimientos a cargo en operaciones de reporto.

En este concepto deberá reportarse el importe de intereses y rendimientos a cargo pagados y los devengados no pagados derivados de operaciones de reporto.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 610400000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126740: Premios a Cargo en operaciones de préstamo de valores.

En este concepto deberá reportarse el importe de los premios a cargo pagados, así como los devengados no pagados por operaciones de préstamo de valores.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 610700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126750: Descuentos por colocación de deuda.

En este concepto deberá reportarse el importe de los descuentos a cargo pagados, así como las devengadas no pagadas por operaciones de colocación de deuda.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 611100000000 del catálogo mínimo.

Concepto 126760: Cuenta de ajuste para cuenta de ingresos por intereses con saldos negativos.

En este concepto deberá reportarse la suma del valor absoluto del saldo negativo perteneciente a cuales quiera de los conceptos de ingresos por intereses.

Para efectos del cómputo de capitalización, el importe de este concepto se sumará al importe 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 restará del importe de los conceptos correspondientes a Ingresos por intereses.

Concepto 126770: Gastos de emisión por Colocación de Deuda.

Al revisar las cifras, el importe de este concepto se comparará con el importe relativo a la cuenta 611700000000 del catálogo mínimo.

Concepto 128010: Monto de la cobertura de seguros relativos a eventos operacionales.

En este concepto deberá reportarse el monto total de la cobertura del seguro, dividido entre el número de meses que ampara la póliza inicial del seguro de cobertura de riesgo operacional.

En caso de operaciones de seguro con un plazo residual de la cobertura menor a un año, el importe a incluir en este concepto deberá calcularse considerando el porcentaje del monto cubierto proporcional que refleje el plazo residual de la póliza, en el entendido de que si dicho plazo residual es menor a 90 días, no se considerará el correspondiente monto cubierto por este seguro. Las pólizas que contemplen cláusulas de renovación automática por un plazo igual o mayor a un año, se considerarán con un plazo residual mayor a un año.

Al realizar el cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional, el importe de este concepto computará hasta por un monto que no exceda del 10 por ciento de la suma de los Ingresos Netos por Concepto de Intereses, más los Ingresos Netos por el Resultado de Operaciones de Compra-venta y los Ingresos Netos por Comisiones y Tarifas Netas.

Concepto 128200: Reservas constituidas por riesgo operacional.

En este concepto deberá reportarse el importe de las reservas efectivamente constituidas por la Institución y que estén asociadas a la disminución del riesgo operacional.

Asimismo, el monto de las reservas a considerarse será sobre una base mensual, es decir, el monto de la reserva que fue constituida en el mes correspondiente.

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	El valor '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 ' no corresponde a un valor del catálogo correspondiente.
Error	19	Valor no válido	El valor '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 ' del elemento 'TipoOperacionImportes2' no es válido

Registro que presenta el diagnóstico

Nombre de la validación

ETAPA: VALIDACIONES HISTÓRICAS



Al dar clic en el estado de la etapa "Validación Histórica" se despliega en pantalla la liga para descargar los diagnósticos. La salida de diagnósticos se muestra de la siguiente manera:

Número identificador de la validación.

Concepto o sección del Formulario donde se presenta el diagnóstico.

FECHA DE CORTE	INSTITUCION	VALIDACION	D_ERROR	CONCEPTO	IMPORTE1_T	IMPORTE1_T_1	RESULTADO1	IMPORTE2_T	IMPORTE2_T_1	RESULTADO2
30/06/2012 12:00:00 a.m.	40000	1	La información reportada en la columnas 1 o 2 del RC01 a la fecha de corte es igual a la reportada el mes inmediato anterior	RC01	1800	1800	0	500	500	0

Descripción del error diagnosticado

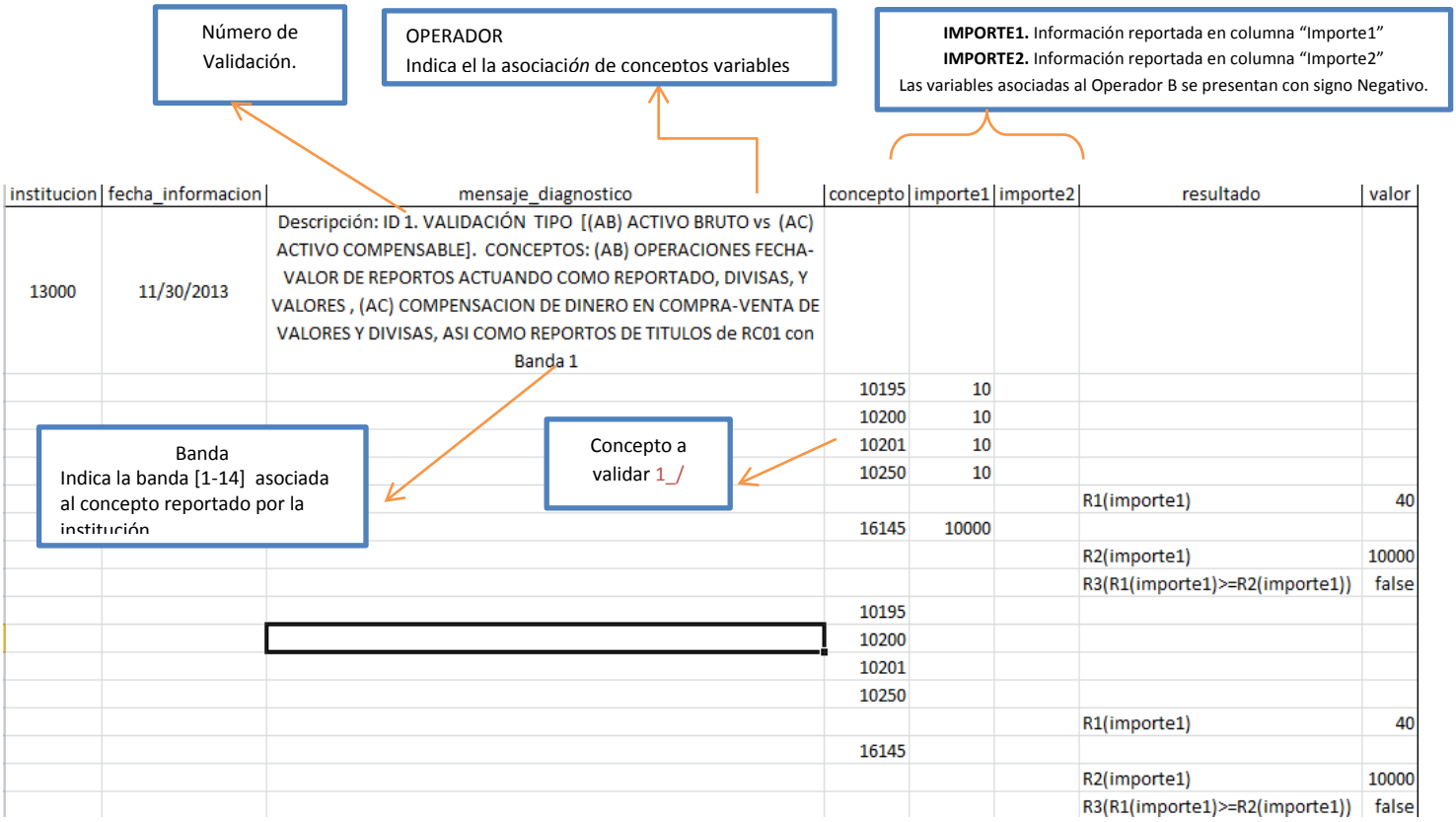
Comparación columna "Importe1".

Comparación columna "Importe2".

IMPORTE#_T. Información reportada a la fecha de corte
IMPORTE#_T_1. Información reportada a la fecha de corte del mes inmediato anterior.
RESULTADO# = IMPORTE#_T – IMPORTE#_T_1

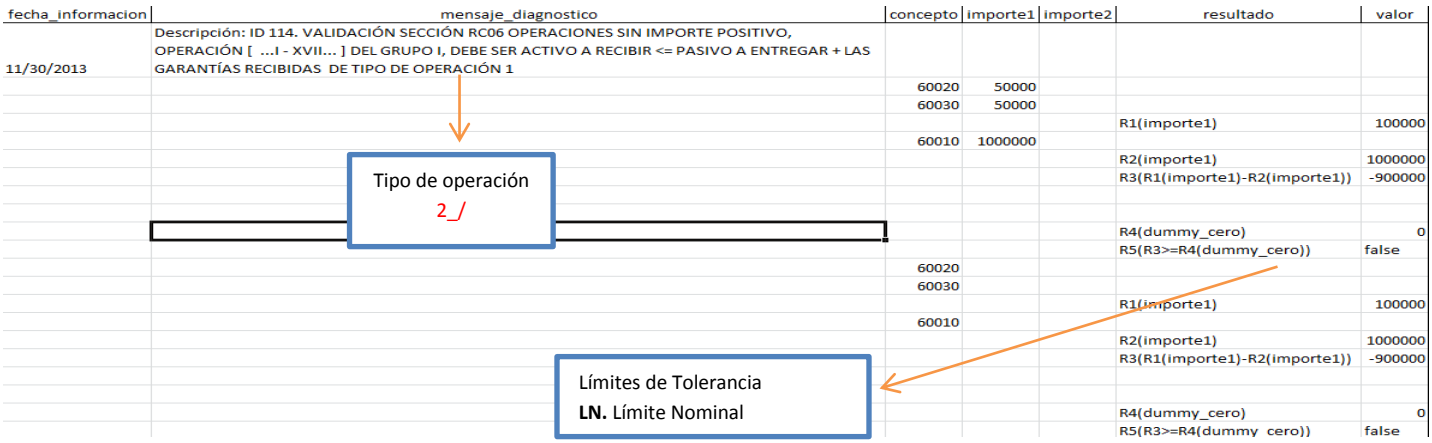
ETAPA: VALIDACIONES CONSISTENCIA DE LA SECCIÓN

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 y RC07 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.

Versión 1.2
Fecha del Documento 11 de diciembre de 2018

ETAPA: VALIDACIONES CONSISTENCIA ENTRE SECCIÓNES

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:

OPERADOR
Indica el la asociación de conceptos variables "A", "B" y el algoritmo.

IMPORTE1. Información reportada en columna "Importe1"
IMPORTE2. Información reportada en columna "Importe2"
Las variables asociadas al Operador B se presentan con signo Negativo.

FECHA DE CORTE	INSTITUCION	VALIDACION	CONCEPTO	OPERADOR	RESULTADO	IMPORTE 1	IMPORTE 2	NOMINAL	PORCENTUAL
31/01/2013	13000	55	93755	A		0	0	0	0.1
31/01/2013	13000	55	84903	A		20688	0	0	0.1
31/01/2013	13000	55	0	|A-B|=0	GRAVE	-20688	0	0	0.1

Número de Validación.

Concepto a validar 1_/

Nivel de Validación
GRAVE. Validación Crítica. No permite continuar con el proceso.
NO GRAVE. Validación de Advertencia de la información. Permite continuar con el proceso

Límites de Tolerancia
LN. Límite Nominal
PORCENTUAL. Límite Porcentual (expresado en decimales)

ETAPA: VALIDACIONES DE FORMATO Y CONSISTENCIA BÁSICA (TÉCNICAS)

i. Objetivo de la validación

Verificar que la estructura solicitada 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.

Adicionalmente se verifica la relación entre campos de cada registro al interior de la sección.

ii. Validaciones por sección.

A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

RC01 a RC09, RC11 y RC12

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
1	Importación	Validación del archivo a importar ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12, el archivo de cada sección debe cumplir con las características para ser importado [.xls,.csv,.txt]*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
2	Tipo de dato (institución)	Valida que el tipo de dato del campo institución sea carácter ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 institución=tipo carácter*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	Tipo de dato (fecha)	Valida que el tipo de dato del campo fecha sea fecha ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 fecha=tipo fecha*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
4	Valida Suma de Campos	Valida que el tipo de dato del campo concepto sea carácter ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 concepto=tipo carácter*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
5	Tipo de dato (importe1)	Valida que el tipo de dato del importe1 sea numérico ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 importe1 =tipo numérico*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
6	Tipo de dato (importe2)	Valida que el tipo de dato del campo importe2 sea numérico ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 importe 2= tipo numérico*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
7	Tipo de dato (importe1)	Valida la longitud/precisión del campo (importe1) ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 longitud de importe 1 =12,3*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
8	Tipo de dato (importe2)	Valida la longitud/precisión del campo (importe2) ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 longitud de importe 2 =12,3*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
9	Unicidad de registro	Valida que bajo las llaves (fecha, institución y concepto), no se repita el registro ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 existan registros con fecha, institución y concepto iguales*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
10	Coherencia con sistemas	Valida fecha de datos con fecha de transmisión ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 fecha (archivo)=fecha de datos seleccionada en el sistema*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
11	Coherencia con sistemas	Valida institución con institución de transmisión ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 institución (archivo) =institución seleccionada en el sistema*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
12	Validación Individual del campo	Valida que el campo importe1 sea diferente de nulo ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 not null (importe1)*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
13	Validación Individual del campo	Valida que el campo importe2 sea diferente de nulo ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 not null (importe2)*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
14	Validación Individual del campo	Valida que el campo FECHA ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 not null (fecha)*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
15	Validación Individual del campo	Valida que el campo INSTITUCION ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12 not null (institución)*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
16	Validación Individual del campo	Valida que el campo importe1 sea mayor o igual a cero ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC08, RC11 y RC12 importe1>0*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
17	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 <>{ 94120, 94130, 94250 ,94350, 90075, 90080, 94150, 94300, 94501 , 94502, 94504, 94505, 94506} => importe1>0* ***Conceptos vigentes hasta octubre 2015:*** ***94120,94130,94250,94350*** ***Concepto vigente a la fecha:*** ***90075, 90080, 94150,94300*** ***Conceptos vigentes a partir de octubre 2015 a la fecha:*** ***94501 , 94502, 94504, 94505, 94506***	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
18	Validación Individual del campo	Valida que el campo Importe2 sea mayor o igual a cero en algunas secciones ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC05, RC07 y RC11 importe2>0*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
19	Validación Individual del campo	Valida que el campo Importe2 sea igual a cero en algunas secciones ***Algoritmo*:** *De las secciones RC06, RC08, RC09 y RC12 importe2=0*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
20	Validación de conceptos que pueden ser reportados	Valida que el concepto enviado por la institución pertenezca al catálogo de conceptos de RC-CB y se encuentre dentro del periodo de vigencia de dicho concepto ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12, Si fecha de alta <=fecha de corte>=fecha de baja y concepto =concepto y sección=Id Sección CONFORME AL NUEVO CATÁLOGO DE CONCEPTOS*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
21	Validación de claves de institución que pueden ser reportadas	Valida que la institución pertenezca al catálogo de Instituciones de RC-CB y se encuentre en operación ***Algoritmo*:** *De las secciones RC01 a RC09, RC11 y RC12, Si fecha de alta <=fecha de corte>=fecha de baja y institución =institución y sección=Id Sección conforme al catálogo de instituciones*	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
22	Valida conceptos que deben ser reportados por institución	Valida que el concepto sea reportado por la institución ***Algoritmo*:** *CONCEPTO OBLIGATORIO: RC09:, 94250, 94350, 90075, 90080, 94150, 94300, 94501, 94502 , 94504, 94505, 94506, 94507* *RC08: 84803,84303.* ***Concepto vigente hasta octubre 2014:*** ***84803*** ***Conceptos vigentes hasta octubre 2015:*** ***94250,94350*** ***Concepto vigente a la fecha:*** ***84303, 90075, 90080, 94150,94300*** ***Conceptos vigentes a partir de octubre 2015 a la fecha:*** ***94501 , 94502, 94504, 94505, 94506,94507***	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
23	Valida conceptos que deben ser distintos de cero	Valida que la institución reporte un ICAP distinto de cero ***Algoritmo*:** *Se la sección RC09 concepto 94300 <> 0*	Grave

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.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC01 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC01* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave
2	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC01 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC01* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC02

No. Validación	Nombre	Descripción/Algoritmo	Nivel
3	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC02 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC02* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave
4	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC02 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC02* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC03

No. Validación	Nombre	Descripción/Algoritmo	Nivel
5	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC03 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC03* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave
6	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC03 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC03* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC04

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
7	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC04 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC04* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave
8	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC04 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC04* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC05

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
9	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC05 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC05 excepto los conceptos: 53050, 53100, 53150, 53200, 53250, 53300, 54050 y 54100* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

10	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC05 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC05* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC06

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
11	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC06 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior ***Algoritmo*:** *De la sección RC06* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC07

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
12	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC07 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC07* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave
13	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC07 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC07* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC08

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
14	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC08 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior ***Algoritmo*:** *De la sección RC08* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"*$_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC09

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
15	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC09, excepto el concepto 92350, para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC09 excepto el concepto 92350* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC11

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
16	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC11 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC11* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave
17	Validación columna: Importe 2.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC11 relativos a sociedades y fondos de inversión (Importe2) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior. ***Algoritmo*:** *De la sección RC11* *ABS(Suma del campo "Importe 2"* $_t$ *- Suma "Importe 2"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave

RC12

No. Validación	Nombre	Descripción/*Algoritmo*	Nivel
18	Validación columna: Importe 1.	Valida que la suma de los importes de todos los conceptos de la sección RC12 para la república y agencias y sucursales (Importe1) sea distinta a la misma suma del mes inmediato anterior ***Algoritmo*:** *De la sección RC12* *ABS(Suma del campo "Importe 1"* $_t$ *- Suma "Importe 1"* $_{t-1}$*) <> 0*	Grave

ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DEL REGISTRO

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.

Adicionalmente se verifica la relación entre campos de cada registro al interior de la sección.

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	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC01) ***Algoritmo***: *Sección = RC01 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC02

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
2	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC02) ***Algoritmo***: *Sección = RC02 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC03

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC03) ***Algoritmo***: *Sección = RC03 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC04

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
4	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC04) ***Algoritmo***: *Sección = RC04 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC05

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
5	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC05) ***Algoritmo*:** *Sección = RC05 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave
6	Valida Conceptos Exclusivos Una columna	Valida que conceptos exclusivos sean reportados en una columna (RC05) ***Algoritmo*:** *(Concepto=52050) or (Concepto=52100) or (Concepto=52150) or (Concepto=52200) or (Concepto=52250) or (Concepto=53050) or (Concepto=53100) or (Concepto=53150) or (Concepto=53200) or (Concepto=53250) or (Concepto=53300) or (Concepto=54050) or (Concepto=54100) entonces Importe 2=0*	Grave

RC06

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
7	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea distinto de 0 (RC06) ***Algoritmo*:** *Sección = RC06 entonces Importe 1 <>0*	Grave
8	Valida Conceptos Exclusivos Una columna	Valida que Un campo de Importe sea reportado en 0 (RC06) ***Algoritmo*:** *Sección = RC06 entonces Importe 2=0*	Grave

RC07

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
9	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC07) ***Algoritmo*:** *Sección = RC07 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC08

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
10	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea distinto de 0 (RC08) ***Algoritmo*:** *Sección = RC08 entonces Importe 1 <>0*	Grave
11	Valida Conceptos Exclusivos Una columna	Valida que Un campo de Importe sea reportado en 0 (RC08) ***Algoritmo*:** *Sección = RC08 entonces Importe 2=0*	Grave

RC09

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
12	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC09) ***Algoritmo*:** *Sección = RC09 entonces Importe 1 <>0*	Grave

13	Valida Conceptos Exclusivos Una columna	Valida que conceptos en particular puedan ser reportados en una columna (RC09) ***Algoritmo*:** *Sección = RC09 entonces Importe 2=0*	Grave

RC11

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
14	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC11) ***Algoritmo*:** *Sección = RC11 entonces Importe 1 + Importe 2 <>0*	Grave

RC12

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
15	Valida Suma de Campos	Valida que la Suma de campos Importes sea diferente de 0 (RC12) ***Algoritmo*:** *Sección = RC12 entonces Importe 1 <>0*	Grave
16	Valida Conceptos Exclusivos Una columna	Valida que Un campo de Importe sea reportado en 0 (RC12) ***Algoritmo*:** *Sección = RC12 entonces Importe 2=0*	Grave

ETAPA: VALIDACIONES AL INTERIOR DEL REGISTRO (ABC)

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.

A continuación se muestra el detalle de cada validación efectuada en esta etapa y para cada sección.

<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:
AB - AC >=0
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>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>BANDA</th><th>RC01</th><th>Ó</th><th>RC04</th></tr>
<tr><td rowspan="4">AB =</td><td>1</td><td>10195</td><td></td><td>40195
40197</td></tr>
<tr><td>1</td><td>10201</td><td></td><td>40200</td></tr>
<tr><td>1</td><td>10200</td><td></td><td>40201</td></tr>
<tr><td>1</td><td>10250</td><td></td><td>40250</td></tr>
<tr><td>AC =</td><td>1</td><td>16145</td><td></td><td>46145</td></tr>
<tr><td rowspan="2">AB =</td><td>2</td><td>11800</td><td></td><td>41859</td></tr>
<tr><td>2</td><td>11801</td><td></td><td>41860</td></tr>
<tr><td>AC =</td><td>2</td><td>16808</td><td></td><td>46148</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: **AB - AC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AB =	1	10550		40550
AC =	1	16150		46150
AB =	2	10552		40552
AC =	2	16152		46152
AB =	3	10504		40554
AC =	3	16154		46154
AB =	4	10556		40556
AC =	4	16156		46156
AB =	5	10558		40558
AC =	5	16158		46158
AB =	6	10560		40560
AC =	6	16160		46160
AB =	7	10562		40562
AC =	7	16162		46162
AB =	8	10564		40564
AC =	8	16164		46164
AB =	9	10566		40566
AC =	9	16166		46166
AB =	10	10568		40568
AC =	10	16168		46168
AB =	11	10570		40570
AC =	11	16170		46170
AB =	12	10572		40572
AC =	12	16172		46172
AB =	13	10574		40574
AC =	13	16174		46174
AB =	14	10576		40576
AC =	14	16176		46176

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*:**

AB - AC >=0

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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC02	Ó	RC11
AB =	1	10300		30300		40300		20300		110300
	1	10350		30350		40350		20350		110350
	1	10400		30400		40400		20400		110400
	1	10450		30450		40450		20450		110450
	1	10500		30500		40500		20500		110500
	1	10600		30600		40600		20600		110600
AC =	1	16180		36180		46180		26000		116180
	1	16210		36210		46210				116210
AB =	2	10302		30302		40302		20302		110302
	2	10352		30352		40352		20352		110352
	2	10402		30402		40402		20402		110402
	2	10452		30452		40452		20452		110452
	2	10502		30502		40502		20502		110502
	2	10602		30602		40602		20602		110602
AC =	2	16182		36182		46182		26002		116182
	2	16212		36212		46212				116212
AB =	3	10304		30304		40304		20304		110304
AB =	3	10354		30354		40354		20354		110354
AB =	3	10404		30404		40404		20404		110404
AB =	3	10454		30454		40454		20454		110454
AB =	3	10504		30504		40504		20504		110504
AB =	3	10604		30604		40604		20604		110604
AC =	3	16184		36184		46184		26004		116184
AC =	3	16214		36214		46214				116214
AB =	4	10306		30306		40306		20306		110306
AB =	4	10356		30356		40356		20356		110356
AB =	4	10406		30406		40406		20406		110406
AB =	4	10456		30456		40456		20456		110456
AB =	4	10506		30506		40506		20506		110506
AB =	4	10606		30606		40606		20606		110606
AC =	4	16186		36186		46186		26006		116186

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
	AC =	4	16216	36216	46216		116216
	AB =	5	10308	30308	40308	20308	110308
	AB =	5	10358	30358	40358	20358	110358
	AB =	5	10408	30408	40408	20408	110408
	AB =	5	10458	30458	40458	20458	110458
	AB =	5	10508	30508	40508	20508	110508
	AB =	5	10608	30608	40608	20608	110608
	AC =	5	16188	36188	46188	26008	116188
	AC =	5	16218	36218	46218		116218
	AB =	6	10310	30310	40310	20310	110310
	AB =	6	10360	30360	40360	20360	110360
	AB =	6	10410	30410	40410	20410	110410
	AB =	6	10460	30460	40460	20460	110460
	AB =	6	10510	30510	40510	20510	110510
	AB =	6	10610	30610	40610	20610	110610
	AC =	6	16190	36190	46190	26010	116190
	AC =	6	16220	36220	46220		116220
	AB =	7	10312	30312	40312	20312	110312
	AB =	7	10362	30362	40362	20362	110362
	AB =	7	10412	30412	40412	20412	110412
	AB =	7	10462	30462	40462	20462	110462
	AB =	7	10512	30512	40512	20512	110512
	AB =	7	10612	30612	40612	20612	110612
	AC =	7	16192	36192	46192	26012	116192
	AC =	7	16222	36222	46222		116222
	AB =	8	10314	30314	40314	20314	110314
	AB =	8	10364	30364	40364	20364	110364
	AB =	8	10414	30414	40414	20414	110414
	AB =	8	10464	30464	40464	20464	110464
	AB =	8	10514	30514	40514	20514	110514
	AB =	8	10614	30614	40614	20614	110614
	AC =	8	16194	36194	46194	26014	116194
	AC =	8	16224	36224	46224		116224
	AB =	9	10316	30316	40316	20316	110316
	AB =	9	10366	30366	40366	20366	110366
	AB =	9	10416	30416	40416	20416	110416
	AB =	9	10466	30466	40466	20466	110466
	AB =	9	10516	30516	40516	20516	110516
	AB =	9	10616	30616	40616	20616	110616
	AC =	9	16196	36196	46196	26016	116196
	AC =	9	16226	36226	46226		116226

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*						Nivel
		AB =	10	10318	30318	40318	20318	110318
		AB =	10	10368	30368	40368	20368	110368
		AB =	10	10418	30418	40418	20418	110418
		AB =	10	10468	30468	40468	20468	110468
		AB =	10	10518	30518	40518	20518	110518
		AB =	10	10618	30618	40618	20618	110618
		AC =	10	16198	36198	46198	26018	116198
		AC =	10	16228	36228	46228		116228
		AB =	11	10320	30320	40320	20320	110320
		AB =	11	10370	30370	40370	20370	110370
		AB =	11	10420	30420	40420	20420	110420
		AB =	11	10470	30470	40470	20470	110470
		AB =	11	10520	30520	40520	20520	110520
		AB =	11	10620	30620	40620	20620	110620
		AC =	11	16200	36200	46200	26020	116200
		AC =	11	16230	36230	46230		116230
		AB =	12	10322	30322	40322	20322	110322
		AB =	12	10372	30372	40372	20372	110372
		AB =	12	10422	30422	40422	20422	110422
		AB =	12	10472	30472	40472	20472	110472
		AB =	12	10522	30522	40522	20522	110522
		AB =	12	10622	30622	40622	20622	110622
		AC =	12	16202	36202	46202	26022	116202
		AC =	12	16232	36232	46232		116232
		AB =	13	10324	30324	40324	20324	110324
		AB =	13	10374	30374	40374	20374	110374
		AB =	13	10424	30424	40424	20424	110424
		AB =	13	10474	30474	40474	20474	110474
		AB =	13	10524	30524	40524	20524	110524
		AB =	13	10624	30624	40624	20624	110624
		AC =	13	16204	36204	46204	26024	116204
		AC =	13	16234	36234	46234		116234
		AB =	14	10326	30326	40326	20326	110326
		AB =	14	10376	30376	40376	20376	110376
		AB =	14	10426	30426	40426	20426	110426
		AB =	14	10476	30476	40476	20476	110476
		AB =	14	10526	30526	40526	20526	110526
		AB =	14	10626	30626	40626	20626	110626
		AC =	14	16206	36206	46206	26026	116206
		AC =	14	16236	36236	46236		116236

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	10630		30630		40630
AB =	1	10690		30690		40690
AC =	1	16240		36240		46240
AB =	2	10632		30632		40632
AB =	2	10692		30692		40692
AC =	2	16242		36242		46242
AB =	3	10634		30634		40634
AB =	3	10694		30694		40694
AC =	3	16244		36244		46244
AB =	4	10636		30636		40636
AB =	4	10696		30696		40696
AC =	4	16246		36246		46246
AB =	5	10638		30638		40638
AB =	5	10698		30698		40698
AC =	5	16248		36248		46248
AB =	6	10640		30640		40640
AB =	6	10700		30700		40700
AC =	6	16250		36250		46250
AB =	7	10642		30642		40642
AB =	7	10702		30702		40702
AC =	7	16252		36252		46252
AB =	8	10644		30644		40644
AB =	8	10704		30704		40704
AC =	8	16254		36254		46254
AB =	9	10646		30646		40646
AB =	9	10706		30706		40706
AC =	9	16256		36256		46256
AB =	10	10648		30648		40648

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AB =	10	10708	30708	40708
AC =	10	16258	36258	46258
AB =	11	10650	30650	40650
AB =	11	10710	30710	40710
AC =	11	16260	36260	46260
AB =	12	10652	30652	40652
AB =	12	10712	30712	40712
AC =	12	16262	36262	46262
AB =	13	10654	30654	40654
AB =	13	10714	30714	40714
AC =	13	16264	36264	46264
AB =	14	10656	30656	40656
AB =	14	10716	30716	40716
AC =	14	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) Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó RC03	Ó RC04
AB =	1	10660	30660	40660
AB =	1	10720	30720	40720
AC =	1	16270	36270	46270
AB =	2	10662	30662	40662
AB =	2	10722	30722	40722
AC =	2	16272	36272	46272
AB =	3	10664	30664	40664
AB =	3	10724	30724	40724
AC =	3	16274	36274	46274
AB =	4	10666	30666	40666
AB =	4	10726	30726	40726
AC =	4	16276	36276	46276
AB =	5	10668	30668	40668

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		AB =	5	10728	30728	40728
		AC =	5	16278	36278	46278
		AB =	6	10670	30670	40670
		AB =	6	10730	30730	40730
		AC =	6	16280	36280	46280
		AB =	7	10672	30672	40672
		AB =	7	10732	30732	40732
		AC =	7	16282	36282	46282
		AB =	8	10674	30674	40674
		AB =	8	10734	30734	40734
		AC =	8	16284	36284	46284
		AB =	9	10676	30676	40676
		AB =	9	10736	30736	40736
		AC =	9	16286	36286	46286
		AB =	10	10678	30678	40678
		AB =	10	10738	30738	40738
		AC =	10	16288	36288	46288
		AB =	11	10680	30680	40680
		AB =	11	10740	30740	40740
		AC =	11	16290	36290	46290
		AB =	12	10682	30682	40682
		AB =	12	10742	30742	40742
		AC =	12	16292	36292	46292
		AB =	13	10684	30684	40684
		AB =	13	10744	30744	40744
		AC =	13	16294	36294	46294
		AB =	14	10686	30686	40686
		AB =	14	10746	30746	40746
		AC =	14	16296	36296	46296

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AB =	1	10750		40780
AB =	1	10780		40840
AC =	1	16300		46330
AB =	2	10752		40782
AB =	2	10782		40842
AC =	2	16302		46332
AB =	3	10754		40784
AB =	3	10784		40844
AC =	3	16304		46334
AB =	4	10756		40786
AB =	4	10786		40846
AC =	4	16306		46336
AB =	5	10758		40788
AB =	5	10788		40848
AC =	5	16308		46338
AB =	6	10760		40790
AB =	6	10790		40850
AC =	6	16310		46340
AB =	7	10762		40792
AB =	7	10792		40852
AC =	7	16312		46342
AB =	8	10764		40794
AB =	8	10794		40854
AC =	8	16314		46344
AB =	9	10766		40796
AB =	9	10796		40856
AC =	9	16316		46346
AB =	10	10768		40798
AB =	10	10798		40858

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	10	16318	46348
AB =	11	10770	40800
AB =	11	10800	40860
AC =	11	16320	46350
AB =	12	10772	40802
AB =	12	10802	40862
AC =	12	16322	46352
AB =	13	10774	40804
AB =	13	10804	40864
AC =	13	16324	46354
AB =	14	10776	40806
AB =	14	10806	40866
AC =	14	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*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	10810		30810		40870		110630
AB =	1	10870		30870		40930		
AC =	1	16330		36330		46360		116240
AB =	2	10812		30812		40872		110632
AB =	2	10872		30872		40932		
AC =	2	16332		36332		46362		116242
AB =	3	10814		30814		40874		110634
AB =	3	10874		30874		40934		
AC =	3	16334		36334		46364		116244
AB =	4	10816		30816		40876		110636
AB =	4	10876		30876		40936		
AC =	4	16336		36336		46366		116246
AB =	5	10818		30818		40878		110638
AB =	5	10878		30878		40938		
AC =	5	16338		36338		46368		116248

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
AB =	6	10820	30820	40880	110640		
AB =	6	10880	30880	40940			
AC =	6	16340	36340	46370	116250		
AB =	7	10822	30822	40882	110642		
AB =	7	10882	30882	40942			
AC =	7	16342	36342	46372	116252		
AB =	8	10824	30824	40884	110644		
AB =	8	10884	30884	40944			
AC =	8	16344	36344	46374	116254		
AB =	9	10826	30826	40886	110646		
AB =	9	10886	30886	40946			
AC =	9	16346	36346	46376	116256		
AB =	10	10828	30828	40888	110648		
AB =	10	10888	30888	40948			
AC =	10	16348	36348	46378	116258		
AB =	11	10830	30830	40890	110650		
AB =	11	10890	30890	40950			
AC =	11	16350	36350	46380	116260		
AB =	12	10832	30832	40892	110652		
AB =	12	10892	30892	40952			
AC =	12	16352	36352	46382	116262		
AB =	13	10834	30834	40894	110654		
AB =	13	10894	30894	40954			
AC =	13	16354	36354	46384	116264		
AB =	14	10836	30836	40896	110656		
AB =	14	10896	30896	40956			
AC =	14	16356	36356	46386	116266		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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*:**

AB - AC >=0
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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	10840		30840		40900		110660
AB =	1	10900		30900		40960		
AC =	1	16360		36360		46390		116270
AB =	2	10842		30842		40902		110662
AB =	2	10902		30902		40962		
AC =	2	16362		36362		46392		116272
AB =	3	10844		30844		40904		110664
AB =	3	10904		30904		40964		
AC =	3	16364		36364		46394		116274
AB =	4	10846		30846		40906		110666
AB =	4	10906		30906		40966		
AC =	4	16366		36366		46396		116276
AB =	5	10848		30848		40908		110668
AB =	5	10908		30908		40968		
AC =	5	16368		36368		46398		116278
AB =	6	10850		30850		40910		110670
AB =	6	10910		30910		40970		
AC =	6	16370		36370		46400		116280
AB =	7	10852		30852		40912		110672
AB =	7	10912		30912		40972		
AC =	7	16372		36372		46402		116282
AB =	8	10854		30854		40914		110674
AB =	8	10914		30914		40974		
AC =	8	16374		36374		46404		116284
AB =	9	10856		30856		40916		110676
AB =	9	10916		30916		40976		
AC =	9	16376		36376		46406		116286
AB =	10	10858		30858		40918		110678
AB =	10	10918		30918		40978		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	10	16378	36378	46408	116288
AB =	11	10860	30860	40920	110680
AB =	11	10920	30920	40980	
AC =	11	16380	36380	46410	116290
AB =	12	10862	30862	40922	110682
AB =	12	10922	30922	40982	
AC =	12	16382	36382	46412	116292
AB =	13	10864	30864	40924	110684
AB =	13	10924	30924	40984	
AC =	13	16384	36384	46414	116294
AB =	14	10866	30866	40926	110686
AB =	14	10926	30926	40986	
AC =	14	16386	36386	46416	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 DE INTERES, (AC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES — Grave

Algoritmo

AB - AC >=0
Con tolerancia de 2

APLICA A LAS SECCIONES RC01 Y RC04 SEGÚN CORRESPONDA, A CADA COLUMNA DE IMPORTES, A CADA UNA DE SUS BANDAS

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	10930		30930		40990
AB =	1	10990		30990		41050
AC =	1	16390		36390		46420
AC =	1	16420		36420		46450
AB =	2	10932		30932		40992
AB =	2	10992		30992		41052
AC =	2	16392		36392		46422
AC =	2	16422		36422		46452
AB =	3	10934		30934		40994
AB =	3	10994		30994		41054
AC =	3	16394		36394		46424
AC =	3	16424		36424		46454
AB =	4	10936		30936		40996
AB =	4	10996		30996		41056
AC =	4	16396		36396		46426
AC =	4	16426		36426		46456
AB =	5	10938		30938		40998

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		AB =	5	10998	30998	41058	
		AC =	5	16398	36398	46428	
		AC =	5	16428	36428	46458	
		AB =	6	10940	30940	41000	
		AB =	6	11000	31000	41060	
		AC =	6	16400	36400	46430	
		AC =	6	16430	36430	46460	
		AB =	7	10942	30942	41002	
		AB =	7	11002	31002	41062	
		AC =	7	16402	36402	46432	
		AC =	7	16432	36432	46462	
		AB =	8	10944	30944	41004	
		AB =	8	11004	31004	41064	
		AC =	8	16404	36404	46434	
		AC =	8	16434	36434	46464	
		AB =	9	10946	30946	41006	
		AB =	9	11006	31006	41066	
		AC =	9	16406	36406	46436	
		AC =	9	16436	36436	46466	
		AB =	10	10948	30948	41008	
		AB =	10	11008	31008	41068	
		AC =	10	16408	36408	46438	
		AC =	10	16438	36438	46468	
		AB =	11	10950	30950	41010	
		AB =	11	11010	31010	41070	
		AC =	11	16410	36410	46440	
		AC =	11	16440	36440	46470	
		AB =	12	10952	30952	41012	
		AB =	12	11012	31012	41072	
		AC =	12	16412	36412	46442	
		AC =	12	16442	36442	46472	
		AB =	13	10954	30954	41014	
		AB =	13	11014	31014	41074	
		AC =	13	16414	36414	46444	
		AC =	13	16444	36444	46474	
		AB =	14	10956	30956	41016	
		AB =	14	11016	31016	41076	
		AC =	14	16416	36416	46446	
		AC =	14	16446	36446	46476	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	10960		30960		41020
AB =	1	11020		31020		41080
AC =	1	16450		36450		46480
AB =	2	10962		30962		41022
AB =	2	11022		31022		41082
AC =	2	16452		36452		46482
AB =	3	10964		30964		41024
AB =	3	11024		31024		41084
AC =	3	16454		36454		46484
AB =	4	10966		30966		41026
AB =	4	11026		31026		41086
AC =	4	16456		36456		46486
AB =	5	10968		30968		41028
AB =	5	11028		31028		41088
AC =	5	16458		36458		46488
AB =	6	10970		30970		41030
AB =	6	11030		31030		41090
AC =	6	16460		36460		46490
AB =	7	10972		30972		41032
AB =	7	11032		31032		41092
AC =	7	16462		36462		46492
AB =	8	10974		30974		41034
AB =	8	11034		31034		41094
AC =	8	16464		36464		46494
AB =	9	10976		30976		41036
AB =	9	11036		31036		41096
AC =	9	16466		36466		46496
AB =	10	10978		30978		41038

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AB =	10	11038	31038	41098
AC =	10	16468	36468	46498
AB =	11	10980	30980	41040
AB =	11	11040	31040	41100
AC =	11	16470	36470	46500
AB =	12	10982	30982	41042
AB =	12	11042	31042	41102
AC =	12	16472	36472	46502
AB =	13	10984	30984	41044
AB =	13	11044	31044	41104
AC =	13	16474	36474	46504
AB =	14	10986	30986	41046
AB =	14	11046	31046	41106
AC =	14	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*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11050		31050		41110		111080
AC =	1	16480		36480		46510		116510
AB =	2	11052		31052		41112		111082
AC =	2	16482		36482		46512		116512
AB =	3	11054		31054		41114		111084
AC =	3	16484		36484		46514		116514
AB =	4	11056		31056		41116		111086
AC =	4	16486		36486		46516		116516
AB =	5	11058		31058		41118		111088
AC =	5	16488		36488		46518		116518
AB =	6	11060		31060		41120		111090
AC =	6	16490		36490		46520		116520
AB =	7	11062		31062		41122		111092
AC =	7	16492		36492		46522		116522
AB =	8	11064		31064		41124		111094
AC =	8	16494		36494		46524		116524

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AB =	9	11066	31066	41126	111096	
AC =	9	16496	36496	46526	116526	
AB =	10	11068	31068	41128	111098	
AC =	10	16498	36498	46528	116528	
AB =	11	11070	31070	41130	111100	
AC =	11	16500	36500	46530	116530	
AB =	12	11072	31072	41132	111102	
AC =	12	16502	36502	46532	116532	
AB =	13	11074	31074	41134	111104	
AC =	13	16504	36504	46534	116534	
AB =	14	11076	31076	41136	111106	
AC =	14	16506	36506	46536	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*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó RC03	Ó RC04
AB =	1	11080	31080	41140
AC =	1	16510	36510	46540
AC =	1	16540	36540	46570
AB =	2	11082	31082	41142
AC =	2	16512	36512	46542
AC =	2	16542	36542	46572
AB =	3	11084	31084	41144
AC =	3	16514	36514	46544
AC =	3	16544	36544	46574
AB =	4	11086	31086	41146
AC =	4	16516	36516	46546
AC =	4	16546	36546	46576
AB =	5	11088	31088	41148
AC =	5	16518	36518	46548
AC =	5	16548	36548	46578
AB =	6	11090	31090	41150
AC =	6	16520	36520	46550

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		AC =	6	16550	36550	46580
		AB =	7	11092	31092	41152
		AC =	7	16522	36522	46552
		AC =	7	16552	36552	46582
		AB =	8	11094	31094	41154
		AC =	8	16524	36524	46554
		AC =	8	16554	36554	46584
		AB =	9	11096	31096	41156
		AC =	9	16526	36526	46556
		AC =	9	16556	36556	46586
		AB =	10	11098	31098	41158
		AC =	10	16528	36528	46558
		AC =	10	16558	36558	46588
		AB =	11	11100	31100	41160
		AC =	11	16530	36530	46560
		AC =	11	16560	36560	46590
		AB =	12	11102	31102	41162
		AC =	12	16532	36532	46562
		AC =	12	16562	36562	46592
		AB =	13	11104	31104	41164
		AC =	13	16534	36534	46564
		AC =	13	16564	36564	46594
		AB =	14	11106	31106	41166
		AC =	14	16536	36536	46566
		AC =	14	16566	36566	46596

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11110		31110		41170
AC =	1	16570		36570		46600
AB =	2	11112		31112		41172
AC =	2	16572		36572		46602
AB =	3	11114		31114		41174
AC =	3	16574		36574		46604
AB =	4	11116		31116		41176
AC =	4	16576		36576		46606
AB =	5	11118		31118		41178
AC =	5	16578		36578		46608
AB =	6	11120		31120		41180
AC =	6	16580		36580		46610
AB =	7	11122		31122		41182
AC =	7	16582		36582		46612
AB =	8	11124		31124		41184
AC =	8	16584		36584		46614
AB =	9	11126		31126		41186
AC =	9	16586		36586		46616
AB =	10	11128		31128		41188
AC =	10	16588		36588		46618
AB =	11	11130		31130		41190
AC =	11	16590		36590		46620
AB =	12	11132		31132		41192
AC =	12	16592		36592		46622
AB =	13	11134		31134		41194
AC =	13	16594		36594		46624
AB =	14	11136		31136		41196
AC =	14	16596		36596		46626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11500		31500		41500
AC =	1	16810		36810		46870
AB =	2	11502		31502		41502
AC =	2	16812		36812		46872
AB =	3	11504		31504		41504
AC =	3	16814		36814		46874
AB =	4	11506		31506		41506
AC =	4	16816		36816		46876
AB =	5	11508		31508		41508
AC =	5	16818		36818		46878
AB =	6	11510		31510		41510
AC =	6	16820		36820		46880
AB =	7	11512		31512		41512
AC =	7	16822		36822		46882
AB =	8	11514		31514		41514
AC =	8	16824		36824		46884
AB =	9	11516		31516		41516
AC =	9	16826		36826		46886
AB =	10	11518		31518		41518
AC =	10	16828		36828		46888
AB =	11	11520		31520		41520
AC =	11	16830		36830		46890
AB =	12	11522		31522		41522
AC =	12	16832		36832		46892
AB =	13	11524		31524		41524
AC =	13	16834		36834		46894
AB =	14	11526		31526		41526
AC =	14	16836		36836		46896

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11530		31530		41530
AC =	1	16840		36840		46900
AB =	2	11532		31532		41532
AC =	2	16842		36842		46902
AB =	3	11534		31534		41534
AC =	3	16844		36844		46904
AB =	4	11536		31536		41536
AC =	4	16846		36846		46906
AB =	5	11538		31538		41538
AC =	5	16848		36848		46908
AB =	6	11540		31540		41540
AC =	6	16850		36850		46910
AB =	7	11542		31542		41542
AC =	7	16852		36852		46912
AB =	8	11544		31544		41544
AC =	8	16854		36854		46914
AB =	9	11546		31546		41546
AC =	9	16856		36856		46916
AB =	10	11548		31548		41548
AC =	10	16858		36858		46918
AB =	11	11550		31550		41550
AC =	11	16860		36860		46920
AB =	12	11552		31552		41552
AC =	12	16862		36862		46922
AB =	13	11554		31554		41554
AC =	13	16864		36864		46924
AB =	14	11556		31556		41556
AC =	14	16866		36866		46926

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
16	ABC_16	ERROR ID 16. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE TASAS DE INTERES, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE TASAS DE INTERES CON OPCIONES DE TENENCIA VENTA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11560		31560		41560
AC =	1	16870		36870		46930
AB =	2	11562		31562		41562
AC =	2	16872		36872		46932
AB =	3	11564		31564		41564
AC =	3	16874		36874		46934
AB =	4	11566		31566		41566
AC =	4	16876		36876		46936
AB =	5	11568		31568		41568
AC =	5	16878		36878		46938
AB =	6	11570		31570		41570
AC =	6	16880		36880		46940
AB =	7	11572		31572		41572
AC =	7	16882		36882		46942
AB =	8	11574		31574		41574
AC =	8	16884		36884		46944
AB =	9	11576		31576		41576
AC =	9	16886		36886		46946
AB =	10	11578		31578		41578
AC =	10	16888		36888		46948
AB =	11	11580		31580		41580
AC =	11	16890		36890		46950
AB =	12	11582		31582		41582
AC =	12	16892		36892		46952
AB =	13	11584		31584		41584
AC =	13	16894		36894		46954
AB =	14	11586		31586		41586
AC =	14	16896		36896		46956

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
17	ABC_17	ERROR ID 17. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE TASAS DE INTERES, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA DE TASAS DE INTERES CON EMISIÓN COMPRA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11590		31590		41590
AC =	1	16900		36900		46960
AB =	2	11592		31592		41592
AC =	2	16902		36902		46962
AB =	3	11594		31594		41594
AC =	3	16904		36904		46964
AB =	4	11596		31596		41596
AC =	4	16906		36906		46966
AB =	5	11598		31598		41598
AC =	5	16908		36908		46968
AB =	6	11600		31600		41600
AC =	6	16910		36910		46970
AB =	7	11602		31602		41602
AC =	7	16912		36912		46972
AB =	8	11604		31604		41604
AC =	8	16914		36914		46974
AB =	9	11606		31606		41606
AC =	9	16916		36916		46976
AB =	10	11608		31608		41608
AC =	10	16918		36918		46978
AB =	11	11610		31610		41610
AC =	11	16920		36920		46980
AB =	12	11612		31612		41612
AC =	12	16922		36922		46982
AB =	13	11614		31614		41614
AC =	13	16924		36924		46984
AB =	14	11616		31616		41616
AC =	14	16926		36926		46986

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
18	ABC_18	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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AB =	1	11620		41620
AC =	1	16930		46990
AB =	2	11622		41622
AC =	2	16932		46992
AB =	3	11624		41624
AC =	3	16934		46994
AB =	4	11626		41626
AC =	4	16936		46996
AB =	5	11628		41628
AC =	5	16938		46998
AB =	6	11630		41630
AC =	6	16940		47000
AB =	7	11632		41632
AC =	7	16942		47002
AB =	8	11634		41634
AC =	8	16944		47004
AB =	9	11636		41636
AC =	9	16946		47006
AB =	10	11638		41638
AC =	10	16948		47008
AB =	11	11640		41640
AC =	11	16950		47010
AB =	12	11642		41642
AC =	12	16952		47012
AB =	13	11644		41644
AC =	13	16954		47014
AB =	14	11646		41646
AC =	14	16956		47016

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AB =	1	11650		41650
AC =	1	16960		47020
AB =	2	11652		41652
AC =	2	16962		47022
AB =	3	11654		41654
AC =	3	16964		47024
AB =	4	11656		41656
AC =	4	16966		47026
AB =	5	11658		41658
AC =	5	16968		47028
AB =	6	11660		41660
AC =	6	16970		47030
AB =	7	11662		41662
AC =	7	16972		47032
AB =	8	11664		41664
AC =	8	16974		47034
AB =	9	11666		41666
AC =	9	16976		47036
AB =	10	11668		41668
AC =	10	16978		47038
AB =	11	11670		41670
AC =	11	16980		47040
AB =	12	11672		41672
AC =	12	16982		47042
AB =	13	11674		41674
AC =	13	16984		47044
AB =	14	11676		41676
AC =	14	16986		47046

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
20	ABC_20	ERROR ID 20. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA DE OTROS SUBYACENTES CON TENENCIA COMPRA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11680		31620		41740		112830
AC =	1	16990		36930		47110		116600
AB =	2	11682		31622		41742		112832
AC =	2	16992		36932		47112		116602
AB =	3	11684		31624		41744		112834
AC =	3	16994		36934		47114		116604
AB =	4	11686		31626		41746		112836
AC =	4	16996		36936		47116		116606
AB =	5	11688		31628		41748		112838
AC =	5	16998		36938		47118		116608
AB =	6	11690		31630		41750		112840
AC =	6	17000		36940		47120		116610
AB =	7	11692		31632		41752		112842
AC =	7	17002		36942		47122		116612
AB =	8	11694		31634		41754		112844
AC =	8	17004		36944		47124		116614
AB =	9	11696		31636		41756		112846
AC =	9	17006		36946		47126		116616
AB =	10	11698		31638		41758		112848
AC =	10	17008		36948		47128		116618
AB =	11	11700		31640		41760		112850
AC =	11	17010		36950		47130		116620
AB =	12	11702		31642		41762		112852
AC =	12	17012		36952		47132		116622
AB =	13	11704		31644		41764		112854
AC =	13	17014		36954		47134		116624
AB =	14	11706		31646		41766		112856
AC =	14	17016		36956		47136		116626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11710		31650		41770		112860
AC =	1	17020		36960		47140		116600
AB =	2	11712		31652		41772		112862
AC =	2	17022		36962		47142		116602
AB =	3	11714		31654		41774		112864
AC =	3	17024		36964		47144		116604
AB =	4	11716		31656		41776		112866
AC =	4	17026		36966		47146		116606
AB =	5	11718		31658		41778		112868
AC =	5	17028		36968		47148		116608
AB =	6	11720		31660		41780		112870
AC =	6	17030		36970		47150		116610
AB =	7	11722		31662		41782		112872
AC =	7	17032		36972		47152		116612
AB =	8	11724		31664		41784		112874
AC =	8	17034		36974		47154		116614
AB =	9	11726		31666		41786		112876
AC =	9	17036		36976		47156		116616
AB =	10	11728		31668		41788		112878
AC =	10	17038		36978		47158		116618
AB =	11	11730		31670		41790		112880
AC =	11	17040		36980		47160		116620
AB =	12	11732		31672		41792		112882
AC =	12	17042		36982		47162		116622
AB =	13	11734		31674		41794		112884
AC =	13	17044		36984		47164		116624
AB =	14	11736		31676		41796		112886
AC =	14	17046		36986		47166		116626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
22	ABC_22	ERROR ID 22. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES SOBRE EMISIÓN VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON OPCIONES DE TENENCIA VENTA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11740		31680		41800		112890
AC =	1	17050		36990		47170		116630
AB =	2	11742		31682		41802		112892
AC =	2	17052		36992		47172		116632
AB =	3	11744		31684		41804		112894
AC =	3	17054		36994		47174		116634
AB =	4	11746		31686		41806		112896
AC =	4	17056		36996		47176		116636
AB =	5	11748		31688		41808		112898
AC =	5	17058		36998		47178		116638
AB =	6	11750		31690		41810		112900
AC =	6	17060		37000		47180		116640
AB =	7	11752		31692		41812		112902
AC =	7	17062		37002		47182		116642
AB =	8	11754		31694		41814		112904
AC =	8	17064		37004		47184		116644
AB =	9	11756		31696		41816		112906
AC =	9	17066		37006		47186		116646
AB =	10	11758		31698		41818		112908
AC =	10	17068		37008		47188		116648
AB =	11	11760		31700		41820		112910
AC =	11	17070		37010		47190		116650
AB =	12	11762		31702		41822		112912
AC =	12	17072		37012		47192		116652
AB =	13	11764		31704		41824		112914
AC =	13	17074		37014		47194		116654
AB =	14	11766		31706		41826		112916
AC =	14	17076		37016		47196		116656

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
23	ABC_23	ERROR ID 23. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE OTROS SUBYACENTES CON OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11770		31710		41830		112920
AC =	1	17080		37020		47200		116630
AB =	2	11772		31712		41832		112922
AC =	2	17082		37022		47202		116632
AB =	3	11774		31714		41834		112924
AC =	3	17084		37024		47204		116634
AB =	4	11776		31716		41836		112926
AC =	4	17086		37026		47206		116636
AB =	5	11778		31718		41838		112928
AC =	5	17088		37028		47208		116638
AB =	6	11780		31720		41840		112930
AC =	6	17090		37030		47210		116640
AB =	7	11782		31722		41842		112932
AC =	7	17092		37032		47212		116642
AB =	8	11784		31724		41844		112934
AC =	8	17094		37034		47214		116644
AB =	9	11786		31726		41846		112936
AC =	9	17096		37036		47216		116646
AB =	10	11788		31728		41848		112938
AC =	10	17098		37038		47218		116648
AB =	11	11790		31730		41850		112940
AC =	11	17100		37040		47220		116650
AB =	12	11792		31732		41852		112942
AC =	12	17102		37042		47222		116652
AB =	13	11794		31734		41854		112944
AC =	13	17104		37044		47224		116654
AB =	14	11796		31736		41856		112946
AC =	14	17106		37046		47226		116656

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
24	ABC_24	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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11290		31290		41380		111290
AC =	1	16750		36750		46810		116750
AB =	2	11292		31292		41382		111292
AC =	2	16752		36752		46812		116752
AB =	3	11294		31294		41384		111294
AC =	3	16754		36754		46814		116754
AB =	4	11296		31296		41386		111296
AC =	4	16756		36756		46816		116756
AB =	5	11298		31298		41388		111298
AC =	5	16758		36758		46818		116758
AB =	6	11300		31300		41390		111300
AC =	6	16760		36760		46820		116760
AB =	7	11302		31302		41392		111302
AC =	7	16762		36762		46822		116762
AB =	8	11304		31304		41394		111304
AC =	8	16764		36764		46824		116764
AB =	9	11306		31306		41396		111306
AC =	9	16766		36766		46826		116766
AB =	10	11308		31308		41398		111308
AC =	10	16768		36768		46828		116768
AB =	11	11310		31310		41400		111310
AC =	11	16770		36770		46830		116770
AB =	12	11312		31312		41402		111312
AC =	12	16772		36772		46832		116772
AB =	13	11314		31314		41404		111314
AC =	13	16774		36774		46834		116774
AB =	14	11316		31316		41406		111316
AC =	14	16776		36776		46836		116776

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
25	ABC_25	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	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AB =	1	11320		31320		41410		111320
AC =	1	16780		36780		46840		116780
AB =	2	11322		31322		41412		111322
AC =	2	16782		36782		46842		116782
AB =	3	11324		31324		41414		111324
AC =	3	16784		36784		46844		116784
AB =	4	11326		31326		41416		111326
AC =	4	16786		36786		46846		116786
AB =	5	11328		31328		41418		111328
AC =	5	16788		36788		46848		116788
AB =	6	11330		31330		41420		111330
AC =	6	16790		36790		46850		116790
AB =	7	11332		31332		41422		111332
AC =	7	16792		36792		46852		116792
AB =	8	11334		31334		41424		111334
AC =	8	16794		36794		46854		116794
AB =	9	11336		31336		41426		111336
AC =	9	16796		36796		46856		116796
AB =	10	11338		31338		41428		111338
AC =	10	16798		36798		46858		116798
AB =	11	11340		31340		41430		111340
AC =	11	16800		36800		46860		116800
AB =	12	11342		31342		41432		111342
AC =	12	16802		36802		46862		116802
AB =	13	11344		31344		41434		111344
AC =	13	16804		36804		46864		116804
AB =	14	11346		31346		41436		111346
AC =	14	16806		36806		46866		116806

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
26	ABC_26	ERROR ID 26. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA, (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AB =	1	11810		31740		41870
AB =	1	11870		31800		41930
AC =	1	17110		37050		47230
AC =	1	17170		37080		47290
AB =	2	11812		31742		41872
AB =	2	11872		31802		41932
AC =	2	17112		37052		47232
AC =	2	17172		37082		47292
AB =	3	11814		31744		41874
AB =	3	11874		31804		41934
AC =	3	17114		37054		47234
AC =	3	17174		37084		47294
AB =	4	11816		31746		41876
AB =	4	11876		31806		41936
AC =	4	17116		37056		47236
AC =	4	17176		37086		47296
AB =	5	11818		31748		41878
AB =	5	11878		31808		41938
AC =	5	17118		37058		47238
AC =	5	17178		37088		47298
AB =	6	11820		31750		41880
AB =	6	11880		31810		41940
AC =	6	17120		37060		47240
AC =	6	17180		37090		47300
AB =	7	11822		31752		41882
AB =	7	11882		31812		41942
AC =	7	17122		37062		47242
AC =	7	17182		37092		47302
AB =	8	11824		31754		41884
AB =	8	11884		31814		41944

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	8	17124	37064	47244	
AC =	8	17184	37094	47304	
AB =	9	11826	31756	41886	
AB =	9	11886	31816	41946	
AC =	9	17126	37066	47246	
AC =	9	17186	37096	47306	
AB =	10	11828	31758	41888	
AB =	10	11888	31818	41948	
AC =	10	17128	37068	47248	
AC =	10	17188	37098	47308	
AB =	11	11830	31760	41890	
AB =	11	11890	31820	41950	
AC =	11	17130	37070	47250	
AC =	11	17190	37100	47310	
AB =	12	11832	31762	41892	
AB =	12	11892	31822	41952	
AC =	12	17132	37072	47252	
AC =	12	17192	37102	47312	
AB =	13	11834	31764	41894	
AB =	13	11894	31824	41954	
AC =	13	17134	37074	47254	
AC =	13	17194	37104	47314	
AB =	14	11836	31766	41896	
AB =	14	11896	31826	41956	
AC =	14	17136	37076	47256	
AC =	14	17196	37106	47316	

27 ABC_27 ERROR ID 27. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA, (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA — Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AB =	1	11840		41900
AB =	1	11900		41960
AC =	1	17140		47260
AB =	2	11842		41902

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		AB =	2	11902	41962	
		AC =	2	17142	47262	
		AB =	3	11844	41904	
		AB =	3	11904	41964	
		AC =	3	17144	47264	
		AB =	4	11846	41906	
		AB =	4	11906	41966	
		AC =	4	17146	47266	
		AB =	5	11848	41908	
		AB =	5	11908	41968	
		AC =	5	17148	47268	
		AB =	6	11850	41910	
		AB =	6	11910	41970	
		AC =	6	17150	47270	
		AB =	7	11852	41912	
		AB =	7	11912	41972	
		AC =	7	17152	47272	
		AB =	8	11854	41914	
		AB =	8	11914	41974	
		AC =	8	17154	47274	
		AB =	9	11856	41916	
		AB =	9	11916	41976	
		AC =	9	17156	47276	
		AB =	10	11858	41918	
		AB =	10	11918	41978	
		AC =	10	17158	47278	
		AB =	11	11860	41920	
		AB =	11	11920	41980	
		AC =	11	17160	47280	
		AB =	12	11862	41922	
		AB =	12	11922	41982	
		AC =	12	17162	47282	
		AB =	13	11864	41924	
		AB =	13	11924	41984	
		AC =	13	17164	47284	
		AB =	14	11866	41926	
		AB =	14	11926	41986	
		AC =	14	17166	47286	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
28	ABC_28	ERROR ID 28. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASAS DE INTERES, (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AB =	1	11380
AC =	1	17200
AB =	2	11382
AC =	2	17202
AB =	3	11384
AC =	3	17204
AB =	4	11386
AC =	4	17206
AB =	5	11388
AC =	5	17208
AB =	6	11390
AC =	6	17210
AB =	7	11392
AC =	7	17212
AB =	8	11394
AC =	8	17214
AB =	9	11396
AC =	9	17216
AB =	10	11398
AC =	10	17218
AB =	11	11400
AC =	11	17220
AB =	12	11402
AC =	12	17222
AB =	13	11404
AC =	13	17224
AB =	14	11406
AC =	14	17226

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
29	ABC_29	ERROR ID 29. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASAS DE INTERES, (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL	Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AB =	1	11410
AC =	1	17230
AB =	2	11412
AC =	2	17232
AB =	3	11414
AC =	3	17234
AB =	4	11416
AC =	4	17236
AB =	5	11418
AC =	5	17238
AB =	6	11420
AC =	6	17240
AB =	7	11422
AC =	7	17242
AB =	8	11424
AC =	8	17244
AB =	9	11426
AC =	9	17246
AB =	10	11428
AC =	10	17248
AB =	11	11430
AC =	11	17250
AB =	12	11432
AC =	12	17252
AB =	13	11434
AC =	13	17254
AB =	14	11436
AC =	14	17256

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
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*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AB =	1	40750
AB =	1	40810
AC =	1	46300
AB =	2	40752
AB =	2	40812
AC =	2	46302
AB =	3	40754
AB =	3	40814
AC =	3	46304
AB =	4	40756
AB =	4	40816
AC =	4	46306
AB =	5	40758
AB =	5	40818
AC =	5	46308
AB =	6	40760
AB =	6	40820
AC =	6	46310
AB =	7	40762
AB =	7	40822
AC =	7	46312
AB =	8	40764
AB =	8	40824
AC =	8	46314
AB =	9	40766
AB =	9	40826
AC =	9	46316
AB =	10	40768
AB =	10	40828
AC =	10	46318

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AB =	11	40770
AB =	11	40830
AC =	11	46320
AB =	12	40772
AB =	12	40832
AC =	12	46322
AB =	13	40774
AB =	13	40834
AC =	13	46324
AB =	14	40776
AB =	14	40836
AC =	14	46326

31 ABC_31 ERROR ID 31. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE DIVISAS, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN VENTA SOBRE DIVISAS CON OPCIONES DE TENENCIA VENTA — Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AB =	1	41680
AC =	1	47050
AB =	2	41682
AC =	2	47052
AB =	3	41684
AC =	3	47054
AB =	4	41686
AC =	4	47056
AB =	5	41688
AC =	5	47058
AB =	6	41690
AC =	6	47060
AB =	7	41692
AC =	7	47062
AB =	8	41694
AC =	8	47064
AB =	9	41696

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	9	47066
AB =	10	41698
AC =	10	47068
AB =	11	41700
AC =	11	47070
AB =	12	41702
AC =	12	47072
AB =	13	41704
AC =	13	47074
AB =	14	41706
AC =	14	47076

32 ABC_32 ERROR ID 32. VALIDACIÓN TIPO [(AB) ACTIVO BRUTO vs (AC) ACTIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AB) OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE DIVISAS, (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE TENENCIA COMPRA SOBRE DIVISAS CON OPCIONES DE EMISIÓN COMPRA — Grave

***Algoritmo*:**

AB - AC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AB =	1	41710
AC =	1	47080
AB =	2	41712
AC =	2	47082
AB =	3	41714
AC =	3	47084
AB =	4	41716
AC =	4	47086
AB =	5	41718
AC =	5	47088
AB =	6	41720
AC =	6	47090
AB =	7	41722
AC =	7	47092
AB =	8	41724
AC =	8	47094
AB =	9	41726

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	9	47096
AB =	10	41728
AC =	10	47098
AB =	11	41730
AC =	11	47100
AB =	12	41732
AC =	12	47102
AB =	13	41734
AC =	13	47104
AB =	14	41736
AC =	14	47106

40 ABC_40 ERROR ID 40. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	13240		43195 43197
PB =	1	13400		43400
PB =	1	13401		43401
PB =	1	13450		43450
PC =	1	18145		48145
PB =	2	14900		44960
PB =	2	14901		44959
PC =	2	18808		48148

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
41	ABC_41	ERROR ID 41. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	13750		43750
PC =	1	18150		48150
PB =	2	13752		43752
PC =	2	18152		48152
PB =	3	13754		43754
PC =	3	18154		48154
PB =	4	13756		43756
PC =	4	18156		48156
PB =	5	13758		43758
PC =	5	18158		48158
PB =	6	13760		43760
PC =	6	18160		48160
PB =	7	13762		43762
PC =	7	18162		48162
PB =	8	13764		43764
PC =	8	18164		48164
PB =	9	13766		43766
PC =	9	18166		48166
PB =	10	13768		43768
PC =	10	18168		48168
PB =	11	13770		43770
PC =	11	18170		48170
PB =	12	13772		43772
PC =	12	18172		48172
PB =	13	13774		43774
PC =	13	18174		48174
PB =	14	13776		43776
PC =	14	18176		48176

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
42	ABC_42	ERROR ID 42. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC02	Ó	RC11
PB =	1	13500		33500		43500		23500		113500
PB =	1	13550		33550		43550		23550		113550
PB =	1	13600		33600		43600		23600		113600
PB =	1	13650		33650		43650		23650		113650
PB =	1	13700		33700		43700		23700		113700
PC =	1	18180		38180		48180		27000		118180
PC =	1	18210		38210		48210				118210
PB =	2	13502		33502		43502		23502		113502
PB =	2	13552		33552		43552		23552		113552
PB =	2	13602		33602		43602		23602		113602
PB =	2	13652		33652		43652		23652		113652
PB =	2	13702		33702		43702		23702		113702
PC =	2	18182		38182		48182		27002		118182
PC =	2	18212		38212		48212				118212
PB =	3	13504		33504		43504		23504		113504
PB =	3	13554		33554		43554		23554		113554
PB =	3	13604		33604		43604		23604		113604
PB =	3	13654		33654		43654		23654		113654
PB =	3	13704		33704		43704		23704		113704
PC =	3	18184		38184		48184		27004		118184
PC =	3	18214		38214		48214				118214
PB =	4	13506		33506		43506		23506		113506
PB =	4	13556		33556		43556		23556		113556
PB =	4	13606		33606		43606		23606		113606
PB =	4	13656		33656		43656		23656		113656
PB =	4	13706		33706		43706		23706		113706
PC =	4	18186		38186		48186		27006		118186
PC =	4	18216		38216		48216				118216
PB =	5	13508		33508		43508		23508		113508
PB =	5	13558		33558		43558		23558		113558

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*							Nivel
		PB =	5	13608	33608	43608	23608	113608	
		PB =	5	13658	33658	43658	23658	113658	
		PB =	5	13708	33708	43708	23708	113708	
		PC =	5	18188	38188	48188	27008	118188	
		PC =	5	18218	38218	48218		118218	
		PB =	6	13510	33510	43510	23510	113510	
		PB =	6	13560	33560	43560	23560	113560	
		PB =	6	13610	33610	43610	23610	113610	
		PB =	6	13660	33660	43660	23660	113660	
		PB =	6	13710	33710	43710	23710	113710	
		PC =	6	18190	38190	48190	27010	118190	
		PC =	6	18220	38220	48220		118220	
		PB =	7	13512	33512	43512	3512	113512	
		PB =	7	13562	33562	43562	23562	113562	
		PB =	7	13612	33612	43612	23612	113612	
		PB =	7	13662	33662	43662	23662	113662	
		PB =	7	13712	33712	43712	23712	113712	
		PC =	7	18192	38192	48192	2701	118192	
		PC =	7	18222	38222	48222		118222	
		PB =	8	13514	33514	43514	23514	113514	
		PB =	8	13564	33564	43564	23564	113564	
		PB =	8	13614	33614	43614	23614	113614	
		PB =	8	13664	33664	43664	23664	113664	
		PB =	8	13714	33714	43714	23714	113714	
		PC =	8	18194	38194	48194	27014	118194	
		PC =	8	18224	38224	48224		118224	
		PB =	9	13516	33516	43516	23516	113516	
		PB =	9	13566	33566	43566	23566	113566	
		PB =	9	13616	33616	43616	23616	113616	
		PB =	9	13666	33666	43666	23666	113666	
		PB =	9	13716	33716	43716	23716	113716	
		PC =	9	18196	38196	48196	27016	118196	
		PC =	9	18226	38226	48226		118226	
		PB =	10	13518	33518	43518	23518	113518	
		PB =	10	13568	33568	43568	23568	113568	
		PB =	10	13618	33618	43618	23618	113618	
		PB =	10	13668	33668	43668	23668	113668	
		PB =	10	13718	33718	43718	23718	113718	
		PC =	10	18198	38198	48198	27018	118198	
		PC =	10	18228	38228	48228		118228	
		PB =	11	13520	33520	43520	23520	113520	
		PB =	11	13570	33570	43570	23570	113570	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	11	13620	33620	43620	23620	113620
PB =	11	13670	33670	43670	23670	113670
PB =	11	13720	33720	43720	23720	113720
PC =	11	18200	38200	48200	27020	118200
PC =	11	18230	38230	48230		118230
PB =	12	13522	33522	43522	23522	113522
PB =	12	13572	33572	43572	23572	113572
PB =	12	13622	33622	43622	23622	113622
PB =	12	13672	33672	43672	23672	113672
PB =	12	13722	33722	43722	23722	113722
PC =	12	18202	38202	48202	27022	118202
PC =	12	18232	38232	48232		118232
PB =	13	13524	33524	43524	23524	113524
PB =	13	13574	33574	43574	23574	113574
PB =	13	13624	33624	43624	23624	113624
PB =	13	13674	33674	43674	23674	113674
PB =	13	13724	33724	43724	23724	113724
PC =	13	18204	38204	48204	27024	118204
PC =	13	18234	38234	48234		118234
PB =	14	13526	33526	43526	23526	113526
PB =	14	13576	33576	43576	23576	113576
PB =	14	13626	33626	43626	23626	113626
PB =	14	13676	33676	43676	23676	113676
PB =	14	13726	33726	43726	23726	113726
PC =	14	18206	38206	48206	27026	118206
PC =	14	18236	38236	48236		118236

43 ABC_43 ERROR ID 43. 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*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	13780		33780		43780
PB =	1	13840		33840		43840
PC =	1	18240		38240		48240

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		PB =	2	13782	33782	43782
		PB =	2	13842	33842	43842
		PC =	2	18242	38242	48242
		PB =	3	13784	33784	43784
		PB =	3	13844	33844	43844
		PC =	3	18244	38244	48244
		PB =	4	13786	33786	43786
		PB =	4	13846	33846	43846
		PC =	4	18246	38246	48246
		PB =	5	13788	33788	43788
		PB =	5	13848	33848	43848
		PC =	5	18248	38248	48248
		PB =	6	13790	33790	43790
		PB =	6	13850	33850	43850
		PC =	6	18250	38250	48250
		PB =	7	13792	33792	43792
		PB =	7	13852	33852	43852
		PC =	7	18252	38252	48252
		PB =	8	13794	33794	43794
		PB =	8	13854	33854	43854
		PC =	8	18254	38254	48254
		PB =	9	13796	33796	43796
		PB =	9	13856	33856	43856
		PC =	9	18256	38256	48256
		PB =	10	13798	33798	43798
		PB =	10	13858	33858	43858
		PC =	10	18258	38258	48258
		PB =	11	13800	33800	43800
		PB =	11	13860	33860	43860
		PC =	11	18260	38260	48260
		PB =	12	13802	33802	43802
		PB =	12	13862	33862	43862
		PC =	12	18262	38262	48262
		PB =	13	13804	33804	43804
		PB =	13	13864	33864	43864
		PC =	13	18264	38264	48264
		PB =	14	13806	33806	43806
		PB =	14	13866	33866	43866
		PC =	14	18266	38266	48266

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
44	ABC_44	ERROR ID 44. 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)	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	13810		33810		43810
PB =	1	13870		33870		43870
PC =	1	18270		38270		48270
PB =	2	13812		33812		43812
PB =	2	13872		33872		43872
PC =	2	18272		38272		48272
PB =	3	13814		33814		43814
PB =	3	13874		33874		43874
PC =	3	18274		38274		48274
PB =	4	13816		33816		43816
PB =	4	13876		33876		43876
PC =	4	18276		38276		48276
PB =	5	13818		33818		43818
PB =	5	13878		33878		43878
PC =	5	18278		38278		48278
PB =	6	13820		33820		43820
PB =	6	13880		33880		43880
PC =	6	18280		38280		48280
PB =	7	13822		33822		43822
PB =	7	13882		33882		43882
PC =	7	18282		38282		48282
PB =	8	13824		33824		43824
PB =	8	13884		33884		43884
PC =	8	18284		38284		48284
PB =	9	13826		33826		43826
PB =	9	13886		33886		43886
PC =	9	18286		38286		48286
PB =	10	13828		33828		43828

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	10	13888	33888	43888
PC =	10	18288	38288	48288
PB =	11	13830	33830	43830
PB =	11	13890	33890	43890
PC =	11	18290	38290	48290
PB =	12	13832	33832	43832
PB =	12	13892	33892	43892
PC =	12	18292	38292	48292
PB =	13	13834	33834	43834
PB =	13	13894	33894	43894
PC =	13	18294	38294	48294
PB =	14	13836	33836	43836
PB =	14	13896	33896	43896
PC =	14	18296	38296	48296

45 ABC_45 ERROR ID 45. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	13900		43900
PB =	1	13930		43960
PC =	1	18300		48300
PB =	2	13902		43902
PB =	2	13932		43962
PC =	2	18302		48302
PB =	3	13904		43904
PB =	3	13934		43964
PC =	3	18304		48304
PB =	4	13906		43906
PB =	4	13936		43966
PC =	4	18306		48306
PB =	5	13908		43908
PB =	5	13938		43968

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	5	18308	48308
PB =	6	13910	43910
PB =	6	13940	43970
PC =	6	18310	48310
PB =	7	13912	43912
PB =	7	13942	43972
PC =	7	18312	48312
PB =	8	13914	43914
PB =	8	13944	43974
PC =	8	18314	48314
PB =	9	13916	43916
PB =	9	13946	43976
PC =	9	18316	48316
PB =	10	13918	43918
PB =	10	13948	43978
PC =	10	18318	48318
PB =	11	13920	43920
PB =	11	13950	43980
PC =	11	18320	48320
PB =	12	13922	43922
PB =	12	13952	43982
PC =	12	18322	48322
PB =	13	13924	43924
PB =	13	13954	43984
PC =	13	18324	48324
PB =	14	13926	43926
PB =	14	13956	43986
PC =	14	18326	48326

46 ABC_46 ERROR ID 46. 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*:**

PB - PC >=0
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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	13960		33960		44020		113780
PB =	1	14020		34020		44080		
PC =	1	18330		38330		48360		118240
PB =	2	13962		33962		44022		113782
PB =	2	14022		34022		44082		
PC =	2	18332		38332		48362		118242
PB =	3	13964		33964		44024		113784
PB =	3	14024		34024		44084		
PC =	3	18334		38334		48364		118244
PB =	4	13966		33966		44026		113786
PB =	4	14026		34026		44086		
PC =	4	18336		38336		48366		118246
PB =	5	13968		33968		44028		113788
PB =	5	14028		34028		44088		
PC =	5	18338		38338		48368		118248
PB =	6	13970		33970		44030		113790
PB =	6	14030		34030		44090		
PC =	6	18340		38340		48370		118250
PB =	7	13972		33972		44032		113792
PB =	7	14032		34032		44092		
PC =	7	18342		38342		48372		118252
PB =	8	13974		33974		44034		113794
PB =	8	14034		34034		44094		
PC =	8	18344		38344		48374		118254
PB =	9	13976		33976		44036		113796
PB =	9	14036		34036		44096		
PC =	9	18346		38346		48376		118256
PB =	10	13978		33978		44038		113798
PB =	10	14038		34038		44098		
PC =	10	18348		38348		48378		118258
PB =	11	13980		33980		44040		113800
PB =	11	14040		34040		44100		
PC =	11	18350		38350		48380		118260
PB =	12	13982		33982		44042		113802
PB =	12	14042		34042		44102		
PC =	12	18352		38352		48382		118262
PB =	13	13984		33984		44044		113804
PB =	13	14044		34044		44104		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	13	18354	38354	48384	118264
PB =	14	13986	33986	44046	113806
PB =	14	14046	34046	44106	
PC =	14	18356	38356	48386	118266

47 ABC_47 ERROR ID 47. 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*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	13990		33990		44050		113810
PB =	1	14050		34050		44110		
PC =	1	18360		38360		48390		118270
PB =	2	13992		33992		44052		113812
PB =	2	14052		34052		44112		
PC =	2	18362		38362		48392		118272
PB =	3	13994		33994		44054		113814
PB =	3	14054		34054		44114		
PC =	3	18364		38364		48394		118274
PB =	4	13996		33996		44056		113816
PB =	4	14056		34056		44116		
PC =	4	18366		38366		48396		118276
PB =	5	13998		33998		44058		113818
PB =	5	14058		34058		44118		
PC =	5	18368		38368		48398		118278
PB =	6	14000		34000		44060		113820
PB =	6	14060		34060		44120		
PC =	6	18370		38370		48400		118280
PB =	7	14002		34002		44062		113822
PB =	7	14062		34062		44122		
PC =	7	18372		38372		48402		118282
PB =	8	14004		34004		44064		113824
PB =	8	14064		34064		44124		
PC =	8	18374		38374		48404		118284

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	9	14006	34006	44066	113826
PB =	9	14066	34066	44126	
PC =	9	18376	38376	48406	118286
PB =	10	14008	34008	44068	113828
PB =	10	14068	34068	44128	
PC =	10	18378	38378	48408	118288
PB =	11	14010	34010	44070	113830
PB =	11	14070	34070	44130	
PC =	11	18380	38380	48410	118290
PB =	12	14012	34012	44072	113832
PB =	12	14072	34072	44132	
PC =	12	18382	38382	48412	118292
PB =	13	14014	34014	44074	113834
PB =	13	14074	34074	44134	
PC =	13	18384	38384	48414	118294
PB =	14	14016	34016	44076	113836
PB =	14	14076	34076	44136	
PC =	14	18386	38386	48416	118296

48 ABC_48 ERROR ID 48. 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*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14080		34080		44140
PB =	1	14140		34140		44200
PC =	1	18390		38390		48420
PB =	2	14082		34082		44142
PB =	2	14142		34142		44202
PC =	2	18392		38392		48422
PB =	3	14084		34084		44144
PB =	3	14144		34144		44204
PC =	3	18394		38394		48424
PB =	4	14086		34086		44146

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		PB =	4	14146	34146	44206	
		PC =	4	18396	38396	48426	
		PB =	5	14088	34088	44148	
		PB =	5	14148	34148	44208	
		PC =	5	18398	38398	48428	
		PB =	6	14090	34090	44150	
		PB =	6	14150	34150	44210	
		PC =	6	18400	38400	48430	
		PB =	7	14092	34092	44152	
		PB =	7	14152	34152	44212	
		PC =	7	18402	38402	48432	
		PB =	8	14094	34094	44154	
		PB =	8	14154	34154	44214	
		PC =	8	18404	38404	48434	
		PB =	9	14096	34096	44156	
		PB =	9	14156	34156	44216	
		PC =	9	18406	38406	48436	
		PB =	10	14098	34098	44158	
		PB =	10	14158	34158	44218	
		PC =	10	18408	38408	48438	
		PB =	11	14100	34100	44160	
		PB =	11	14160	34160	44220	
		PC =	11	18410	38410	48440	
		PB =	12	14102	34102	44162	
		PB =	12	14162	34162	44222	
		PC =	12	18412	38412	48442	
		PB =	13	14104	34104	44164	
		PB =	13	14164	34164	44224	
		PC =	13	18414	38414	48444	
		PB =	14	14106	34106	44166	
		PB =	14	14166	34166	44226	
		PC =	14	18416	38416	48446	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
49	ABC_49	ERROR ID 49. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14110		34110		44170
PB =	1	14170		34170		44230
PC =	1	18420		38420		48450
PC =	1	18450		38450		48480
PB =	2	14112		34112		44172
PB =	2	14172		34172		44232
PC =	2	18422		38422		48452
PC =	2	18452		38452		48482
PB =	3	14114		34114		44174
PB =	3	14174		34174		44234
PC =	3	18424		38424		48454
PC =	3	18454		38454		48484
PB =	4	14116		34116		44176
PB =	4	14176		34176		44236
PC =	4	18426		38426		48456
PC =	4	18456		38456		48486
PB =	5	14118		34118		44178
PB =	5	14178		34178		44238
PC =	5	18428		38428		48458
PC =	5	18458		38458		48488
PB =	6	14120		34120		44180
PB =	6	14180		34180		44240
PC =	6	18430		38430		48460
PC =	6	18460		38460		48490
PB =	7	14122		34122		44182
PB =	7	14182		34182		44242
PC =	7	18432		38432		48462
PC =	7	18462		38462		48492
PB =	8	14124		34124		44184
PB =	8	14184		34184		44244
PC =	8	18434		38434		48464
PC =	8	18464		38464		48494

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	9	14126	34126	44186
PB =	9	14186	34186	44246
PC =	9	18436	38436	48466
PC =	9	18466	38466	48496
PB =	10	14128	34128	44188
PB =	10	14188	34188	44248
PC =	10	18438	38438	48468
PC =	10	18468	38468	48498
PB =	11	14130	34130	44190
PB =	11	14190	34190	44250
PC =	11	18440	38440	48470
PC =	11	18470	38470	48500
PB =	12	14132	34132	44192
PB =	12	14192	34192	44252
PC =	12	18442	38442	48472
PC =	12	18472	38472	48502
PB =	13	14134	34134	44194
PB =	13	14194	34194	44254
PC =	13	18444	38444	48474
PC =	13	18474	38474	48504
PB =	14	14136	34136	44196
PB =	14	14196	34196	44256
PC =	14	18446	38446	48476
PC =	14	18476	38476	48506

50 ABC_50 ERROR ID 50. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14200		34200		44260		114230
PC =	1	18480		38480		48510		118510
PB =	2	14202		34202		44262		114232
PC =	2	18482		38482		48512		118512
PB =	3	14204		34204		44264		14234
PC =	3	18484		38484		48514		118514

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	4	14206	34206	44266	114236
PC =	4	18486	38486	48516	118516
PB =	5	14208	34208	44268	114238
PC =	5	18488	38488	48518	118518
PB =	6	14210	34210	44270	114240
PC =	6	18490	38490	48520	118520
PB =	7	14212	34212	44272	114242
PC =	7	18492	38492	48522	118522
PB =	8	14214	34214	44274	114244
PC =	8	18494	38494	48524	118524
PB =	9	14216	34216	44276	114246
PC =	9	18496	38496	48526	118526
PB =	10	14218	34218	44278	114248
PC =	10	18498	38498	48528	118528
PB =	11	14220	34220	44280	114250
PC =	11	18500	38500	48530	118530
PB =	12	14222	34222	44282	114252
PC =	12	18502	38502	48532	118532
PB =	13	14224	34224	44284	114254
PC =	13	18504	38504	48534	118534
PB =	14	14226	34226	44286	114256
PC =	14	18506	38506	48536	118536

51 ABC_51 ERROR ID 51. 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

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14230		34230		44290
PC =	1	18510		38510		48540
PC =	1	18540		38540		48570
PB =	2	14232		34232		44292
PC =	2	18512		38512		48542
PC =	2	18542		38542		48572
PB =	3	14234		34234		44294

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		PC =	3	18514	38514	48544	
		PC =	3	18544	38544	48574	
		PB =	4	14236	34236	44296	
		PC =	4	18516	38516	48546	
		PC =	4	18546	38546	48576	
		PB =	5	14238	34238	44298	
		PC =	5	18518	38518	48548	
		PC =	5	18548	38548	48578	
		PB =	6	14240	34240	4430	
		PC =	6	18520	38520	48550	
		PC =	6	18550	38550	48580	
		PB =	7	14242	34242	44302	
		PC =	7	18522	38522	48552	
		PC =	7	18552	38552	48582	
		PB =	8	14244	34244	44304	
		PC =	8	18524	38524	48554	
		PC =	8	18554	38554	48584	
		PB =	9	14246	34246	44306	
		PC =	9	18526	38526	48556	
		PC =	9	18556	38556	48586	
		PB =	10	14248	34248	44308	
		PC =	10	18528	38528	48558	
		PC =	10	18558	38558	48588	
		PB =	11	14250	34250	44310	
		PC =	11	18530	38530	48560	
		PC =	11	18560	38560	48590	
		PB =	12	14252	34252	44312	
		PC =	12	18532	38532	48562	
		PC =	12	18562	38562	48592	
		PB =	13	14254	34254	44314	
		PC =	13	18534	38534	48564	
		PC =	13	18564	38564	48594	
		PB =	14	14256	34256	44316	
		PC =	14	18536	38536	48566	
		PC =	14	18566	38566	48596	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
52	ABC_52	ERROR ID 52. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14260		34260		44320
PC =	1	18570		38570		48600
PB =	2	14262		34262		44322
PC =	2	18572		38572		48602
PB =	3	14264		34264		44324
PC =	3	18574		38574		48604
PB =	4	14266		34266		44326
PC =	4	18576		38576		48606
PB =	5	14268		34268		44328
PC =	5	18578		38578		48608
PB =	6	14270		34270		44330
PC =	6	18580		38580		48610
PB =	7	14272		34272		44332
PC =	7	18582		38582		48612
PB =	8	14274		34274		44334
PC =	8	18584		38584		48614
PB =	9	14276		34276		44336
PC =	9	18586		38586		48616
PB =	10	14278		34278		44338
PC =	10	18588		38588		48618
PB =	11	14280		34280		44340
PC =	11	18590		38590		48620
PB =	12	14282		34282		44342
PC =	12	18592		38592		48622
PB =	13	14284		34284		44344
PC =	13	18594		38594		48624
PB =	14	14286		34286		44346
PC =	14	18596		38596		48626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
53	ABC_53	ERROR ID 53. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14600		34600		44600
PC =	1	18810		38810		48870
PB =	2	14602		34602		44602
PC =	2	18812		38812		48872
PB =	3	14604		34604		44604
PC =	3	18814		38814		48874
PB =	4	14606		34606		44606
PC =	4	18816		38816		48876
PB =	5	14608		34608		44608
PC =	5	18818		38818		48878
PB =	6	14610		34610		44610
PC =	6	18820		38820		48880
PB =	7	14612		34612		44612
PC =	7	18822		38822		48882
PB =	8	14614		34614		44614
PC =	8	18824		38824		48884
PB =	9	14616		34616		44616
PC =	9	18826		38826		48886
PB =	10	14618		34618		44618
PC =	10	18828		38828		48888
PB =	11	14620		34620		44620
PC =	11	18830		38830		48890
PB =	12	14622		34622		44622
PC =	12	18832		38832		48892
PB =	13	14624		34624		44624
PC =	13	18834		38834		48894
PB =	14	14626		34626		44626
PC =	14	18836		38836		48896

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
54	ABC_54	ERROR ID 54. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14630		34630		44630
PC =	1	18840		38840		48900
PB =	2	14632		34632		44632
PC =	2	18842		38842		48902
PB =	3	14634		34634		44634
PC =	3	18844		38844		48904
PB =	4	14636		34636		44636
PC =	4	18846		38846		48906
PB =	5	14638		34638		44638
PC =	5	18848		38848		48908
PB =	6	14640		34640		44640
PC =	6	18850		38850		48910
PB =	7	14642		34642		44642
PC =	7	18852		38852		48912
PB =	8	14644		34644		44644
PC =	8	18854		38854		48914
PB =	9	14646		34646		44646
PC =	9	18856		38856		48916
PB =	10	14648		34648		44648
PC =	10	18858		38858		48918
PB =	11	14650		34650		44650
PC =	11	18860		38860		48920
PB =	12	14652		34652		44652
PC =	12	18862		38862		48922
PB =	13	14654		34654		44654
PC =	13	18864		38864		48924
PB =	14	14656		34656		44656
PC =	14	18866		38866		48926

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
55	ABC_55	ERROR ID 55. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14660		34660		44660
PC =	1	18870		38870		48930
PB =	2	14662		34662		44662
PC =	2	18872		38872		48932
PB =	3	14664		34664		44664
PC =	3	18874		38874		48934
PB =	4	14666		34666		44666
PC =	4	18876		38876		48936
PB =	5	14668		34668		44668
PC =	5	18878		38878		48938
PB =	6	14670		34670		44670
PC =	6	18880		38880		48940
PB =	7	14672		34672		44672
PC =	7	18882		38882		48942
PB =	8	14674		34674		44674
PC =	8	18884		38884		48944
PB =	9	14676		34676		44676
PC =	9	18886		38886		48946
PB =	10	14678		34678		44678
PC =	10	18888		38888		48948
PB =	11	14680		34680		44680
PC =	11	18890		38890		48950
PB =	12	14682		34682		44682
PC =	12	18892		38892		48952
PB =	13	14684		34684		44684
PC =	13	18894		38894		48954
PB =	14	14686		34686		44686
PC =	14	18896		38896		48956

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
56	ABC_56	ERROR ID 56. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14690		34690		44690
PC =	1	18900		38900		48960
PB =	2	14692		34692		44692
PC =	2	18902		38902		48962
PB =	3	14694		34694		44694
PC =	3	18904		38904		48964
PB =	4	14696		34696		44696
PC =	4	18906		38906		48966
PB =	5	14698		34698		44698
PC =	5	18908		38908		48968
PB =	6	14700		34700		44700
PC =	6	18910		38910		48970
PB =	7	14702		34702		44702
PC =	7	18912		38912		48972
PB =	8	14704		34704		44704
PC =	8	18914		38914		48974
PB =	9	14706		34706		44706
PC =	9	18916		38916		48976
PB =	10	14708		34708		44708
PC =	10	18918		38918		48978
PB =	11	14710		34710		44710
PC =	11	18920		38920		48980
PB =	12	14712		34712		44712
PC =	12	8922		38922		48982
PB =	13	14714		34714		44714
PC =	13	18924		38924		48984
PB =	14	14716		34716		44716
PC =	14	18926		38926		48986

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
57	ABC_57	ERROR ID 57. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	14720		44780
PC =	1	18930		49050
PB =	2	14722		44782
PC =	2	18932		49052
PB =	3	14724		44784
PC =	3	18934		49054
PB =	4	14726		44786
PC =	4	18936		49056
PB =	5	14728		44788
PC =	5	18938		49058
PB =	6	14730		44790
PC =	6	18940		49060
PB =	7	14732		44792
PC =	7	18942		49062
PB =	8	14734		44794
PC =	8	18944		49064
PB =	9	14736		44796
PC =	9	18946		49066
PB =	10	14738		44798
PC =	10	18948		49068
PB =	11	14740		44800
PC =	11	18950		49070
PB =	12	14742		44802
PC =	12	18952		49072
PB =	13	14744		44804
PC =	13	18954		49074
PB =	14	14746		44806
PC =	14	18956		49076

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
58	ABC_58	ERROR ID 58. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	14750		44810
PC =	1	18960		49080
PB =	2	14752		44812
PC =	2	18962		9082
PB =	3	14754		44814
PC =	3	18964		49084
PB =	4	14756		44816
PC =	4	18966		49086
PB =	5	14758		44818
PC =	5	18968		49088
PB =	6	14760		44820
PC =	6	18970		49090
PB =	7	14762		44822
PC =	7	18972		49092
PB =	8	14764		44824
PC =	8	18974		49094
PB =	9	14766		44826
PC =	9	18976		49096
PB =	10	14768		44828
PC =	10	18978		49098
PB =	11	14770		44830
PC =	11	18980		49100
PB =	12	14772		44832
PC =	12	18982		49102
PB =	13	14774		44834
PC =	13	18984		49104
PB =	14	14776		44836
PC =	14	18986		49106

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
59	ABC_59	ERROR ID 59. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14780		34720		44840		115850
PC =	1	18990		38930		49110		118600
PB =	2	14782		34722		44842		115852
PC =	2	18992		38932		49112		118602
PB =	3	14784		4724		44844		115854
PC =	3	18994		38934		49114		118604
PB =	4	14786		34726		44846		115856
PC =	4	18996		38936		49116		118606
PB =	5	14788		34728		44848		115858
PC =	5	18998		38938		49118		118608
PB =	6	14790		34730		44850		115860
PC =	6	19000		38940		49120		118610
PB =	7	14792		34732		44852		115862
PC =	7	19002		38942		49122		118612
PB =	8	14794		34734		44854		115864
PC =	8	19004		38944		49124		118614
PB =	9	14796		34736		44856		115866
PC =	9	19006		38946		49126		118616
PB =	10	14798		34738		44858		115868
PC =	10	19008		38948		49128		118618
PB =	11	14800		34740		44860		115870
PC =	11	19010		38950		49130		118620
PB =	12	14802		34742		44862		115872
PC =	12	19012		38952		49132		118622
PB =	13	14804		34744		44864		115874
PC =	13	19014		38954		49134		118624
PB =	14	14806		34746		44866		115876
PC =	14	19016		38956		49136		118626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
60	ABC_60	ERROR ID 60. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14810		34750		44870		115880
PC =	1	19020		38960		49140		118600
PB =	2	14812		34752		44872		115882
PC =	2	19022		38962		49142		118602
PB =	3	14814		34754		44874		115884
PC =	3	19024		38964		49144		118604
PB =	4	14816		34756		44876		115886
PC =	4	19026		38966		49146		118606
PB =	5	14818		34758		44878		115888
PC =	5	19028		38968		49148		118608
PB =	6	14820		34760		44880		115890
PC =	6	19030		38970		49150		118610
PB =	7	14822		34762		44882		115892
PC =	7	19032		38972		49152		118612
PB =	8	14824		34764		44884		115894
PC =	8	19034		38974		49154		118614
PB =	9	14826		34766		44886		115896
PC =	9	19036		38976		49156		118616
PB =	10	14828		34768		44888		115898
PC =	10	19038		38978		49158		118618
PB =	11	14830		34770		44890		115900
PC =	11	19040		38980		49160		118620
PB =	12	14832		34772		44892		115902
PC =	12	19042		38982		49162		118622
PB =	13	14834		34774		44894		115904
PC =	13	19044		38984		49164		118624
PB =	14	14836		34776		44896		115906
PC =	14	19046		38986		49166		118626

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
61	ABC_61	ERROR ID 61. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14840		34780		44900		115910
PC =	1	19050		38990		49170		118630
PB =	2	14842		34782		44902		115912
PC =	2	19052		38992		49172		118632
PB =	3	14844		34784		44904		115914
PC =	3	19054		38994		49174		118634
PB =	4	14846		34786		44906		115916
PC =	4	19056		38996		49176		118636
PB =	5	14848		34788		44908		115918
PC =	5	19058		38998		49178		118638
PB =	6	14850		34790		44910		115920
PC =	6	19060		39000		49180		118640
PB =	7	14852		34792		44912		115922
PC =	7	19062		39002		49182		118642
PB =	8	14854		34794		44914		115924
PC =	8	19064		39004		49184		118644
PB =	9	14856		34796		44916		115926
PC =	9	19066		39006		49186		118646
PB =	10	14858		34798		44918		115928
PC =	10	19068		39008		49188		118648
PB =	11	14860		34800		44920		115930
PC =	11	19070		39010		49190		118650
PB =	12	14862		34802		44922		115932
PC =	12	19072		39012		49192		118652
PB =	13	14864		34804		44924		115934
PC =	13	19074		39014		49194		118654
PB =	14	14866		34806		44926		115936
PC =	14	19076		39016		49196		118656

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
62	ABC_62	ERROR ID 62. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14870		34810		44930		115940
PC =	1	19080		39020		49200		118630
PB =	2	14872		34812		44932		115942
PC =	2	19082		39022		49202		118632
PB =	3	14874		34814		44934		115944
PC =	3	19084		39024		49204		118634
PB =	4	14876		34816		44936		115946
PC =	4	19086		39026		49206		118636
PB =	5	14878		34818		44938		115948
PC =	5	19088		39028		49208		118638
PB =	6	14880		34820		44940		115950
PC =	6	19090		39030		49210		118640
PB =	7	14882		34822		44942		115952
PC =	7	19092		39032		49212		118642
PB =	8	14884		34824		44944		115954
PC =	8	19094		39034		49214		118644
PB =	9	14886		34826		44946		115956
PC =	9	19096		39036		49216		118646
PB =	10	14888		34828		44948		115958
PC =	10	19098		39038		49218		118648
PB =	11	14890		34830		44950		115960
PC =	11	19100		39040		49220		118650
PB =	12	14892		34832		44952		115962
PC =	12	19102		39042		49222		118652
PB =	13	14894		34834		44954		115964
PC =	13	19104		39044		49224		118654
PB =	14	14896		34836		44956		115966
PC =	14	19106		39046		49226		118656

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
63	ABC_63	ERROR ID 63. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL, (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14440		34440		44530		114440
PC =	1	18750		38750		48810		118750
PB =	2	14442		34442		44532		114442
PC =	2	18752		38752		48812		118752
PB =	3	14444		34444		44534		114444
PC =	3	18754		38754		48814		118754
PB =	4	14446		34446		44536		114446
PC =	4	18756		38756		48816		118756
PB =	5	14448		34448		44538		114448
PC =	5	18758		38758		48818		118758
PB =	6	14450		34450		44540		114450
PC =	6	18760		38760		48820		118760
PB =	7	14452		34452		44542		114452
PC =	7	18762		38762		48822		118762
PB =	8	14454		34454		44544		114454
PC =	8	18764		38764		48824		118764
PB =	9	14456		34456		44546		114456
PC =	9	18766		38766		48826		118766
PB =	10	14458		34458		44548		114458
PC =	10	18768		38768		48828		118768
PB =	11	14460		34460		44550		114460
PC =	11	18770		38770		48830		118770
PB =	12	14462		34462		44552		114462
PC =	12	18772		38772		48832		118772
PB =	13	14464		34464		44554		114464
PC =	13	18774		38774		48834		118774
PB =	14	14466		34466		44556		114466
PC =	14	18776		38776		48836		118776

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
64	ABC_64	ERROR ID 64. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO, (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
PB =	1	14470		34470		44560		114470
PC =	1	18780		38780		48840		118780
PB =	2	14472		34472		44562		114472
PC =	2	18782		38782		48842		118782
PB =	3	14474		34474		44564		114474
PC =	3	18784		38784		48844		118784
PB =	4	14476		34476		44566		114476
PC =	4	18786		38786		48846		118786
PB =	5	14478		34478		44568		114478
PC =	5	18788		38788		48848		118788
PB =	6	14480		34480		44570		114480
PC =	6	18790		38790		48850		118790
PB =	7	14482		34482		44572		114482
PC =	7	18792		38792		48852		118792
PB =	8	14484		34484		44574		114484
PC =	8	18794		38794		48854		118794
PB =	9	14486		34486		44576		114486
PC =	9	18796		38796		48856		118796
PB =	10	14488		34488		44578		114488
PC =	10	18798		38798		48858		118798
PB =	11	14490		34490		44580		114490
PC =	11	18800		38800		48860		118800
PB =	12	14492		34492		44582		114492
PC =	12	18802		38802		48862		118802
PB =	13	14494		34494		44584		114494
PC =	13	18804		38804		48864		118804
PB =	14	14496		34496		44586		114496
PC =	14	18806		38806		48866		118806

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
65	ABC_65	ERROR ID 65. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
PB =	1	14910		44970
PB =	1	14970		45030
PC =	1	19110		49230
PB =	2	14912		44972
PB =	2	14972		45032
PC =	2	19112		49232
PB =	3	14914		44974
PB =	3	14974		45034
PC =	3	19114		49234
PB =	4	14916		44976
PB =	4	14976		45036
PC =	4	19116		49236
PB =	5	14918		44978
PB =	5	14978		45038
PC =	5	19118		49238
PB =	6	14920		44980
PB =	6	14980		45040
PC =	6	19120		49240
PB =	7	14922		44982
PB =	7	14982		45042
PC =	7	19122		49242
PB =	8	14924		44984
PB =	8	14984		45044
PC =	8	19124		49244
PB =	9	14926		44986
PB =	9	14986		45046
PC =	9	19126		49246
PB =	10	14928		44988
PB =	10	14988		45048
PC =	10	19128		49248
PB =	11	14930		44990

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	11	14990	45050
PC =	11	19130	49250
PB =	12	14932	44992
PB =	12	14992	45052
PC =	12	19132	49252
PB =	13	14934	44994
PB =	13	14994	45054
PC =	13	19134	49254
PB =	14	14936	44996
PB =	14	14996	45056
PC =	14	19136	49256

66 ABC_66 ERROR ID 66. VALIDACIÓN TIPO [(PB) PASIVO BRUTO, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (PB) CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA — Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
PB =	1	14940		34870		45000
PB =	1	14998		34930		45060
PC =	1	19140		39050		49260
PC =	1	19170		39080		49290
PB =	2	14942		34872		45002
PB =	2	15000		34932		45062
PC =	2	19142		39052		49262
PC =	2	19172		39082		49292
PB =	3	14944		34874		45004
PB =	3	15002		34934		45064
PC =	3	19144		39054		49264
PC =	3	19174		39084		49294
PB =	4	14946		34876		45006
PB =	4	15004		34936		45066
PC =	4	19146		39056		49266
PC =	4	19176		39086		49296
PB =	5	14948		34878		45008
PB =	5	15006		34938		45068

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		PC =	5	19148	39058	49268
		PC =	5	19178	39088	49298
		PB =	6	14950	34880	45010
		PB =	6	15008	34940	45070
		PC =	6	19150	39060	49270
		PC =	6	19180	39090	49300
		PB =	7	14952	34882	45012
		PB =	7	15010	34942	45072
		PC =	7	19152	39062	49272
		PC =	7	19182	39092	49302
		PB =	8	14954	34884	45014
		PB =	8	15012	34944	45074
		PC =	8	19154	39064	49274
		PC =	8	19184	39094	49304
		PB =	9	14956	34886	45016
		PB =	9	15014	34946	45076
		PC =	9	19156	39066	49276
		PC =	9	19186	39096	49306
		PB =	10	14958	34888	45018
		PB =	10	15016	34948	45078
		PC =	10	19158	39068	49278
		PC =	10	19188	39098	49308
		PB =	11	14960	34890	45020
		PB =	11	15018	34950	45080
		PC =	11	19160	39070	49280
		PC =	11	19190	39100	49310
		PB =	12	14962	34892	45022
		PB =	12	15020	34952	45082
		PC =	12	19162	39072	49282
		PC =	12	19192	39102	49312
		PB =	13	14964	34894	45024
		PB =	13	15022	34954	45084
		PC =	13	19164	39074	49284
		PC =	13	19194	39104	49314
		PB =	14	14966	34896	45026
		PB =	14	15024	34956	45086
		PC =	14	19166	39076	49286
		PC =	14	19196	39106	49316

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
67	ABC_67	ERROR ID 67. 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

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
PB =	1	14530
PC =	1	19200
PB =	2	14532
PC =	2	19202
PB =	3	14534
PC =	3	19204
PB =	4	14536
PC =	4	19206
PB =	5	14538
PC =	5	19208
PB =	6	14540
PC =	6	19210
PB =	7	14542
PC =	7	19212
PB =	8	14544
PC =	8	19214
PB =	9	14546
PC =	9	19216
PB =	10	14548
PC =	10	19218
PB =	11	14550
PC =	11	19220
PB =	12	14552
PC =	12	19222
PB =	13	14554
PC =	13	19224
PB =	14	14556
PC =	14	19226

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
68	ABC_68	ERROR ID 68. 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

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
PB =	1	14560
PC =	1	19230
PB =	2	14562
PC =	2	19232
PB =	3	14564
PC =	3	19234
PB =	4	14566
PC =	4	19236
PB =	5	14568
PC =	5	19238
PB =	6	14570
PC =	6	19240
PB =	7	14572
PC =	7	19242
PB =	8	14574
PC =	8	19244
PB =	9	14576
PC =	9	19246
PB =	10	14578
PC =	10	19248
PB =	11	14580
PC =	11	19250
PB =	12	14582
PC =	12	19252
PB =	13	14584
PC =	13	19254
PB =	14	14586
PC =	14	19256

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
69	ABC_69	ERROR ID 69. 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	Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
PB =	1	43930
PB =	1	43990
PC =	1	48330
PB =	2	43932
PB =	2	43992
PC =	2	48332
PB =	3	43934
PB =	3	43994
PC =	3	48334
PB =	4	43936
PB =	4	43996
PC =	4	48336
PB =	5	43938
PB =	5	43998
PC =	5	48338
PB =	6	43940
PB =	6	44000
PC =	6	48340
PB =	7	43942
PB =	7	44002
PC =	7	48342
PB =	8	43944
PB =	8	44004
PC =	8	48344
PB =	9	43946
PB =	9	44006
PC =	9	48346
PB =	10	43948
PB =	10	44008
PC =	10	48348

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	11	43950
PB =	11	44010
PC =	11	48350
PB =	12	43952
PB =	12	44012
PC =	12	48352
PB =	13	43954
PB =	13	44014
PC =	13	48354
PB =	14	43956
PB =	14	44016
PC =	14	48356

70 | ABC_70 | ERROR ID 70. 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 | Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
PB =	1	44720
PC =	1	48990
PB =	2	44722
PC =	2	48992
PB =	3	44724
PC =	3	48994
PB =	4	44726
PC =	4	48996
PB =	5	44728
PC =	5	48998
PB =	6	44730
PC =	6	49000
PB =	7	44732
PC =	7	49002
PB =	8	44734
PC =	8	49004
PB =	9	44736

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	9	49006
PB =	10	4738
PC =	10	49008
PB =	11	44740
PC =	11	49010
PB =	12	44742
PC =	12	49012
PB =	13	44744
PC =	13	49014
PB =	14	44746
PC =	14	49016

71 ABC_71 ERROR ID 71. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

PB - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
PB =	1	44750
PC =	1	49020
PB =	2	44752
PC =	2	49022
PB =	3	44754
PC =	3	49024
PB =	4	44756
PC =	4	49026
PB =	5	44758
PC =	5	49028
PB =	6	44760
PC =	6	49030
PB =	7	44762
PC =	7	49032
PB =	8	44764
PC =	8	49034

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PB =	9	44766
PC =	9	49036
PB =	10	4768
PC =	10	49038
PB =	11	44770
PC =	11	49040
PB =	12	44772
PC =	12	49042
PB =	13	44774
PC =	13	49044
PB =	14	44776
PC =	14	49046

80 ABC_80 ERROR ID 80. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	16145		46145
PC =	1	18145		48145
AC =	2	16808		46148
PC =	2	18808		48148

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
81	ABC_81	ERROR ID 81. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADOR, (PC) REPORTOS ACTUANDO COMO REPORTADO	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	16150		46150
PC =	1	18150		48150
AC =	2	16152		46152
PC =	2	18152		48152
AC =	3	16154		46154
PC =	3	18154		48154
AC =	4	16156		46156
PC =	4	18156		48156
AC =	5	16158		46158
PC =	5	18158		48158
AC =	6	16160		46160
PC =	6	18160		48160
AC =	7	16162		46162
PC =	7	18162		48162
AC =	8	16164		46164
PC =	8	18164		48164
AC =	9	16166		46166
PC =	9	18166		48166
AC =	10	16168		46168
PC =	10	18168		48168
AC =	11	16170		46170
PC =	11	18170		48170
AC =	12	16172		46172
PC =	12	18172		48172
AC =	13	16174		46174
PC =	13	18174		48174
AC =	14	16176		46176
PC =	14	18176		48176

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
82	ABC_82	ERROR ID 82. 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

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC02	Ó	RC11
AC =	1	16180		36180		46180		26000		116180
PC =	1	18180		38180		48180		27000		118180
AC =	2	16182		36182		46182		26002		116182
PC =	2	18182		38182		48182		27002		118182
AC =	3	16184		36184		46184		26004		116184
PC =	3	18184		38184		48 84		27004		118184
AC =	4	16186		36186		46186		26006		116186
PC =	4	18186		38186		48186		27006		118186
AC =	5	16188		36188		46188		26008		116188
PC =	5	18188		38188		48188		27008		118188
AC =	6	16190		36190		46190		26010		116190
PC =	6	18190		38190		48190		27010		118190
AC =	7	16192		36192		46192		26012		116192
PC =	7	18192		38192		48192		27012		118192
AC =	8	16194		36194		46194		26014		116194
PC =	8	18194		38194		48194		27014		118194
AC =	9	16196		36196		46196		26016		116196
PC =	9	18196		38196		48196		27016		118196
AC =	10	16198		36198		46198		26018		116198
PC =	10	18198		38198		48198		27018		118198
AC =	11	16200		36200		46200		26020		116200
PC =	11	18200		38200		48200		27020		118200
AC =	12	16202		36202		46202		26022		116202
PC =	12	18202		38202		48202		27022		118202
AC =	13	16204		36204		46204		26024		116204
PC =	13	18204		38204		48204		27024		118204
AC =	14	16206		36206		46206		26026		116206
PC =	14	18206		38206		48206		27026		118206

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
83	ABC_83	ERROR ID 83. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16210		36210		46210		116210
PC =	1	18420		38420		48450		
PC =	1	18510		38510		48540		
PC =	1	19170		39080		49290		
AC =	2	16212		36212		46212		116212
PC =	2	18422		38422		48452		
PC =	2	18512		38512		48542		
PC =	2	19172		39082		49292		
AC =	3	16214		36214		46214		116214
PC =	3	18424		38424		48454		
PC =	3	18514		38514		48544		
PC =	3	19174		39084		49294		
AC =	4	16216		36216		46216		116216
PC =	4	18426		38426		48456		
PC =	4	18516		38516		48546		
PC =	4	19176		39086		49296		
AC =	5	16218		36218		46218		116218
PC =	5	18428		38428		48458		
PC =	5	18518		38518		48548		
PC =	5	19178		39088		49298		
AC =	6	16220		36220		46220		116220
PC =	6	18430		38430		48460		
PC =	6	18520		38520		48550		
PC =	6	19180		39090		49300		
AC =	7	16222		36222		46222		116222
PC =	7	18432		38432		48462		
PC =	7	18522		38522		48552		
PC =	7	19182		39092		49302		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		AC =	8	16224	36224	46224	116224
		PC =	8	18434	38434	48464	
		PC =	8	18524	38524	48554	
		PC =	8	19184	39094	49304	
		AC =	9	16226	36226	46226	116226
		PC =	9	18436	38436	48466	
		PC =	9	18526	38526	48556	
		PC =	9	19186	39096	49306	
		AC =	10	16228	36228	46228	116228
		PC =	10	18438	38438	48468	
		PC =	10	18528	38528	48558	
		PC =	10	19188	39098	49308	
		AC =	11	16230	36230	46230	116230
		PC =	11	18440	38440	48470	
		PC =	11	18530	38530	48560	
		PC =	11	19190	39100	49310	
		AC =	12	16232	36232	46232	116232
		PC =	12	18442	38442	48472	
		PC =	12	18532	38532	48562	
		PC =	12	19192	39102	49312	
		AC =	13	16234	36234	46234	116234
		PC =	13	18444	38444	48474	
		PC =	13	18534	38534	48564	
		PC =	13	19194	39104	49314	
		AC =	14	16236	36236	46236	116236
		PC =	14	18446	38446	48476	
		PC =	14	18536	38536	48566	
		PC =	14	19196	39106	49316	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
84	ABC_84	ERROR ID 84. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES), (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERES (DISTINTOS A LOS PAQUETES)	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	16240		36240		46240
PC =	1	18270		38270		48270
AC =	2	16242		36242		46242
PC =	2	18272		38272		48272
AC =	3	16244		36244		46244
PC =	3	18274		38274		48274
AC =	4	16246		36246		46246
PC =	4	18276		38276		48276
AC =	5	16248		36248		46248
PC =	5	18278		38278		48278
AC =	6	16250		36250		46250
PC =	6	18280		38280		48280
AC =	7	16252		36252		46252
PC =	7	18282		38282		48282
AC =	8	16254		36254		46254
PC =	8	18284		38284		48284
AC =	9	16256		36256		46256
PC =	9	18286		38286		48286
AC =	10	16258		36258		46258
PC =	10	18288		38288		48288
AC =	11	16260		36260		46260
PC =	11	18290		38290		48290
AC =	12	16262		36262		46262
PC =	12	18292		38292		48292
AC =	13	16264		36264		46264
PC =	13	18294		38294		48294
AC =	14	16266		36266		46266
PC =	14	18296		38296		48296

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
85	ABC_85	ERROR ID 85. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	16270		36270		46270
PC =	1	18240		38240		48240
AC =	2	16272		36272		46272
PC =	2	18242		38242		48242
AC =	3	16274		36274		46274
PC =	3	18244		38244		48244
AC =	4	16276		36276		46276
PC =	4	18246		38246		48246
AC =	5	16278		36278		46278
PC =	5	18248		38248		48248
AC =	6	16280		36280		46280
PC =	6	18250		38250		48250
AC =	7	16282		36282		46282
PC =	7	18252		38252		48252
AC =	8	16284		36284		46284
PC =	8	18254		38254		48254
AC =	9	16286		36286		46286
PC =	9	18256		38256		48256
AC =	10	16288		36288		46288
PC =	10	18258		38258		48258
AC =	11	16290		36290		46290
PC =	11	18260		38260		48260
AC =	12	16292		36292		46292
PC =	12	18262		38262		48262
AC =	13	16294		36294		46294
PC =	13	18264		38264		48264
AC =	14	16296		36296		46296
PC =	14	18266		38266		48266

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
86	ABC_86	ERROR ID 86. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	16300		46330
PC =	1	18300		48300
AC =	2	16302		46332
PC =	2	18302		48302
AC =	3	16304		46334
PC =	3	18304		48304
AC =	4	16306		46336
PC =	4	18306		48306
AC =	5	16308		46338
PC =	5	18308		48308
AC =	6	16310		46340
PC =	6	18310		48310
AC =	7	16312		46342
PC =	7	18312		48312
AC =	8	16314		46344
PC =	8	18314		48314
AC =	9	16316		46346
PC =	9	18316		48316
AC =	10	16318		46348
PC =	10	18318		48318
AC =	11	16320		46350
PC =	11	18320		48320
AC =	12	16322		46352
PC =	12	18322		48322
AC =	13	16324		46354
PC =	13	18324		48324
AC =	14	16326		46356
PC =	14	18326		48326

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
87	ABC_87	ERROR ID 87. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16330		36330		46360		116240
PC =	1	18360		38360		48390		118270
AC =	2	16332		36332		46362		116242
PC =	2	18362		38362		48392		118272
AC =	3	16334		36334		46364		116244
PC =	3	18364		38364		48394		118274
AC =	4	16336		36336		46366		116246
PC =	4	18366		38366		48396		118276
AC =	5	16338		36338		46368		116248
PC =	5	18368		38368		48398		118278
AC =	6	16340		36340		46370		116250
PC =	6	18370		38370		48400		118280
AC =	7	16342		36342		46372		116252
PC =	7	18372		38372		48402		118282
AC =	8	16344		36344		46374		116254
PC =	8	18374		38374		48404		118284
AC =	9	16346		36346		46376		116256
PC =	9	18376		38376		48406		118286
AC =	10	16348		36348		46378		116258
PC =	10	18378		38378		48408		118288
AC =	11	16350		36350		46380		116260
PC =	11	18380		38380		48410		118290
AC =	12	16352		36352		46382		116262
PC =	12	18382		38382		48412		118292
AC =	13	16354		36354		46384		116264
PC =	13	18384		38384		48414		118294
AC =	14	16356		36356		46386		116266
PC =	14	18386		38386		48416		118296

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
88	ABC_88	ERROR ID 88. 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	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16360		36360		46390		116270
PC =	1	18330		38330		48360		118240
AC =	2	16362		36362		46392		116272
PC =	2	18332		38332		48362		118242
AC =	3	16364		36364		46394		116274
PC =	3	18334		38334		48364		118244
AC =	4	16366		36366		46396		116276
PC =	4	18336		38336		48366		118246
AC =	5	16368		36368		46398		116278
PC =	5	18338		38338		48368		118248
AC =	6	16370		36370		46400		116280
PC =	6	18340		38340		48370		118250
AC =	7	16372		36372		46402		116282
PC =	7	18342		38342		48372		118252
AC =	8	16374		36374		46404		116284
PC =	8	18344		38344		48374		118254
AC =	9	16376		36376		46406		116286
PC =	9	18346		38346		48376		118256
AC =	10	16378		36378		46408		116288
PC =	10	18348		38348		48378		118258
AC =	11	16380		36380		46410		116290
PC =	11	18350		38350		48380		118260
AC =	12	16382		36382		46412		116292
PC =	12	18352		38352		48382		118262
AC =	13	16384		36384		46414		116294
PC =	13	18354		38354		48384		118264
AC =	14	16386		36386		46416		116296
PC =	14	18356		38356		48386		118266

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
89	ABC_89	ERROR ID 89. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA, PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERÉS Y SWAPS DE TASA DE INTERÉS FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE TITULOS DE DEUDA	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16390		36390		46420		
AC =	1	16510		36510		46540		
AC =	1	17170		37080		47290		
PC =	1	18210		38210		48210		118210
AC =	2	16392		36392		46422		
AC =	2	16512		36512		46542		
AC =	2	17172		37082		47292		
PC =	2	18212		38212		48212		118212
AC =	3	16394		36394		46424		
AC =	3	16514		36514		46544		
AC =	3	17174		37084		47294		
PC =	3	18214		38214		48214		118214
AC =	4	16396		36396		46426		
AC =	4	16516		36516		46546		
AC =	4	17176		37086		47296		
PC =	4	18216		38216		48216		118216
AC =	5	16398		36398		46428		
AC =	5	16518		36518		46548		
AC =	5	17178		37088		47298		
PC =	5	18218		38218		48218		118218
AC =	6	16400		36400		46430		
AC =	6	16520		36520		46550		
AC =	6	17180		37090		47300		
PC =	6	18220		38220		48220		118220
AC =	7	16402		36402		46432		
AC =	7	16522		36522		46552		
AC =	7	17182		37092		47302		
PC =	7	18222		38222		48222		118222
AC =	8	16404		36404		46434		

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	8	16524	36524	46554	
AC =	8	17184	37094	47304	
PC =	8	18224	38224	48224	118224
AC =	9	16406	36406	46436	
AC =	9	16526	36526	46556	
AC =	9	17186	37096	47306	
PC =	9	18226	38226	48226	118226
AC =	10	16408	36408	46438	
AC =	10	16528	36528	46558	
AC =	10	17188	37098	47308	
PC =	10	18228	38228	48228	118228
AC =	11	16410	36410	46440	
AC =	11	16530	36530	46560	
AC =	11	17190	37100	47310	
PC =	11	18230	38230	48230	118230
AC =	12	16412	36412	46442	
AC =	12	16532	36532	46562	
AC =	12	17192	37102	47312	
PC =	12	18232	38232	48232	118232
AC =	13	16414	36414	46444	
AC =	13	16534	36534	46564	
AC =	13	17194	37104	47314	
PC =	13	18234	38234	48234	118234
AC =	14	16416	36416	46446	
AC =	14	16536	36536	46566	
AC =	14	17196	37106	47316	
PC =	14	18236	38236	48236	118236

90 ABC_90

ERROR ID 90. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE TASA DE INTERES Y SWAPS DE TASA DE INTERÉS FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE PAQUETES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE TASA DE INTERÉS FIJA Y SWAPS DE TASA DE INTERES FIJA

Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	16420		36420		46450
AC =	1	16540		36540		46570

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*					Nivel
		PC =	1	18450	38450	48480	
		PC =	1	18540	38540	48570	
		AC =	2	16422	36422	46452	
		AC =	2	16542	36542	46572	
		PC =	2	18452	38452	48482	
		PC =	2	18542	38542	48572	
		AC =	3	16424	36424	46454	
		AC =	3	16544	36544	46574	
		PC =	3	18454	38454	48484	
		PC =	3	18544	38544	48574	
		AC =	4	16426	36426	46456	
		AC =	4	16546	36546	46576	
		PC =	4	18456	38456	48486	
		PC =	4	18546	38546	48576	
		AC =	5	16428	36428	46458	
		AC =	5	16548	36548	46578	
		PC =	5	18458	38458	48488	
		PC =	5	18548	38548	48578	
		AC =	6	16430	36430	46460	
		AC =	6	16550	36550	46580	
		PC =	6	18460	38460	48490	
		PC =	6	18550	38550	48580	
		AC =	7	16432	36432	46462	
		AC =	7	16552	36552	46582	
		PC =	7	18462	38462	48492	
		PC =	7	18552	38552	48582	
		AC =	8	16434	36434	46464	
		AC =	8	16554	36554	46584	
		PC =	8	18464	38464	48494	
		PC =	8	18554	38554	48584	
		AC =	9	16436	36436	46466	
		AC =	9	16556	36556	46586	
		PC =	9	18466	38466	48496	
		PC =	9	18556	38556	48586	
		AC =	10	16438	36438	46468	
		AC =	10	16558	36558	46588	
		PC =	10	18468	38468	48498	
		PC =	10	18558	38558	48588	
		AC =	11	16440	36440	46470	
		AC =	11	16560	36560	46590	
		PC =	11	18470	38470	48500	
		PC =	11	18560	38560	48590	

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	12	16442	36442	46472
AC =	12	16562	36562	46592
PC =	12	18472	38472	48502
PC =	12	18562	38562	48592
AC =	13	16444	36444	46474
AC =	13	16564	36564	46594
PC =	13	18474	38474	48504
PC =	13	18564	38564	48594
AC =	14	16446	36446	46476
AC =	14	16566	36566	46596
PC =	14	18476	38476	48506
PC =	14	18566	38566	48596

91 ABC_91 ERROR ID 91. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó RC03	Ó RC04
AC =	1	16450	36450	46480
PC =	1	18390	38390	48420
AC =	2	16452	36452	46482
PC =	2	18392	38392	48422
AC =	3	16454	36454	46484
PC =	3	18394	38394	48424
AC =	4	16456	36456	46486
PC =	4	18396	38396	48426
AC =	5	16458	36458	46488
PC =	5	18398	38398	48428
AC =	6	16460	36460	46490
PC =	6	18400	38400	48430
AC =	7	16462	36462	46492
PC =	7	18402	38402	48432
AC =	8	16464	36464	46494
PC =	8	18404	38404	48434

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	9	16466	36466	46496
PC =	9	18406	38406	48436
AC =	10	16468	36468	46498
PC =	10	18408	38408	48438
AC =	11	16470	36470	46500
PC =	11	18410	38410	48440
AC =	12	16472	36472	46502
PC =	12	18412	38412	48442
AC =	13	16474	36474	46504
PC =	13	18414	38414	48444
AC =	14	16476	36476	46506
PC =	14	18416	38416	48446

92 ABC_92 ERROR ID 92. 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*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16480		36480		46510		116510
PC =	1	18480		38480		48510		118510
AC =	2	16482		36482		46512		116512
PC =	2	18482		38482		48512		118512
AC =	3	16484		36484		46514		116514
PC =	3	18484		38484		48514		118514
AC =	4	16486		36486		46516		116516
PC =	4	18486		38486		48516		118516
AC =	5	16488		36488		46518		116518
PC =	5	18488		38488		48518		118518
AC =	6	16490		36490		46520		116520
PC =	6	18490		38490		48520		118520
AC =	7	16492		36492		46522		116522
PC =	7	18492		38492		48522		118522
AC =	8	16494		36494		46524		116524
PC =	8	18494		38494		48524		118524
AC =	9	16496		36496		46526		116526

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	9	18496	38496	48526	118526
AC =	10	16498	36498	46528	116528
PC =	10	18498	38498	48528	118528
AC =	11	16500	36500	46530	116530
PC =	11	18500	38500	48530	118530
AC =	12	16502	36502	46532	116532
PC =	12	18502	38502	48532	118532
AC =	13	16504	36504	46534	116534
PC =	13	18504	38504	48534	118534
AC =	14	16506	36506	46536	116536
PC =	14	18506	38506	48536	118536

93 ABC_93 ERROR ID 93. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	16570		36570		46600
PC =	1	18570		38570		48600
AC =	2	16572		36572		46602
PC =	2	18572		38572		48602
AC =	3	16574		36574		46604
PC =	3	18574		38574		48604
AC =	4	16576		36576		46606
PC =	4	18576		38576		48606
AC =	5	16578		36578		46608
PC =	5	18578		38578		48608
AC =	6	16580		36580		46610
PC =	6	18580		38580		48610
AC =	7	16582		36582		46612
PC =	7	18582		38582		48612
AC =	8	16584		36584		46614
PC =	8	18584		38584		48614
AC =	9	16586		36586		46616
PC =	9	18586		38586		48616

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	10	16588	36588	46618
PC =	10	18588	38588	48618
AC =	11	16590	36590	46620
PC =	11	18590	38590	48620
AC =	12	16592	36592	46622
PC =	12	18592	38592	48622
AC =	13	16594	36594	46624
PC =	13	18594	38594	48624
AC =	14	16596	36596	46626
PC =	14	18596	38596	48626

94 ABC_94 ERROR ID 94. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó RC03	Ó RC04
AC =	1	16810	36810	46870
PC =	1	18900	38900	48960
AC =	2	16812	36812	46872
PC =	2	18902	38902	48962
AC =	3	16814	36814	46874
PC =	3	18904	38904	48964
AC =	4	16816	36816	46876
PC =	4	18906	38906	48966
AC =	5	16818	36818	46878
PC =	5	18908	38908	48968
AC =	6	16820	36820	46880
PC =	6	18910	38910	48970
AC =	7	16822	36822	46882
PC =	7	18912	38912	48972
AC =	8	16824	36824	46884
PC =	8	18914	38914	48974
AC =	9	16826	36826	46886
PC =	9	18916	38916	48976
AC =	10	16828	36828	46888

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	10	18918	38918	48978
AC =	11	16830	36830	46890
PC =	11	18920	38920	48980
AC =	12	16832	36832	46892
PC =	12	18922	38922	48982
AC =	13	16834	36834	46894
PC =	13	18924	38924	48984
AC =	14	16836	36836	46896
PC =	14	18926	38926	48986

95 ABC_95 ERROR ID 95. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01 Ó RC03 Ó RC04		
AC =	1	16840	36840	46900
PC =	1	18870	38870	48930
AC =	2	16842	36842	46902
PC =	2	18872	38872	48932
AC =	3	16844	36844	46904
PC =	3	18874	38874	48934
AC =	4	16846	36846	46906
PC =	4	18876	38876	48936
AC =	5	16848	36848	46908
PC =	5	18878	38878	48938
AC =	6	16850	36850	46910
PC =	6	18880	38880	48940
AC =	7	16852	36852	46912
PC =	7	18882	38882	48942
AC =	8	16854	36854	46914
PC =	8	18884	38884	48944
AC =	9	16856	36856	46916
PC =	9	18886	38886	48946
AC =	10	16858	36858	46918
PC =	10	18888	38888	48948

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	11	16860	36860	46920
PC =	11	18890	38890	48950
AC =	12	16862	36862	46922
PC =	12	18892	38892	48952
AC =	13	16864	36864	46924
PC =	13	18894	38894	48954
AC =	14	16866	36866	46926
PC =	14	18896	38896	48956

96 ABC_96 ERROR ID 96. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	16870		36870		46930
PC =	1	18840		38840		48900
AC =	2	16872		36872		46932
PC =	2	18842		38842		48902
AC =	3	16874		36874		46934
PC =	3	18844		38844		48904
AC =	4	16876		36876		46936
PC =	4	18846		38846		48906
AC =	5	16878		36878		46938
PC =	5	18848		38848		48908
AC =	6	16880		36880		46940
PC =	6	18850		38850		48910
AC =	7	16882		36882		46942
PC =	7	18852		38852		48912
AC =	8	16884		36884		46944
PC =	8	18854		38854		48914
AC =	9	16886		36886		46946
PC =	9	18856		38856		48916
AC =	10	16888		36888		46948
PC =	10	18858		38858		48918
AC =	11	16890		36890		46950

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	11	18860	38860	48920
AC =	12	16892	36892	46952
PC =	12	18862	38862	48922
AC =	13	16894	36894	46954
PC =	13	18864	38864	48924
AC =	14	16896	36896	46956
PC =	14	18866	38866	48926

97 ABC_97 ERROR ID 97. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01 Ó RC03 Ó RC04		
AC =	1	16900	36900	46960
PC =	1	18810	38810	48870
AC =	2	16902	36902	46962
PC =	2	18812	38812	48872
AC =	3	16904	36904	46964
PC =	3	18814	38814	48874
AC =	4	16906	36906	46966
PC =	4	18816	38816	48876
AC =	5	16908	36908	46968
PC =	5	18818	38818	48878
AC =	6	16910	36910	46970
PC =	6	18820	38820	48880
AC =	7	16912	36912	46972
PC =	7	18822	38822	48882
AC =	8	16914	36914	46974
PC =	8	18824	38824	48884
AC =	9	16916	36916	46976
PC =	9	18826	38826	48886
AC =	10	16918	36918	46978
PC =	10	18828	38828	48888
AC =	11	16920	36920	46980
PC =	11	18830	38830	48890

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	12	16922	36922	46982
PC =	12	18832	38832	48892
AC =	13	16924	36924	46984
PC =	13	18834	38834	48894
AC =	14	16926	36926	46986
PC =	14	18836	38836	48896

98 ABC_98 ERROR ID 98. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	16930		46990
PC =	1	18960		49080
AC =	2	16932		46992
PC =	2	18962		49082
AC =	3	16934		46994
PC =	3	18964		49084
AC =	4	16936		46996
PC =	4	18966		49086
AC =	5	16938		46998
PC =	5	18968		49088
AC =	6	16940		47000
PC =	6	18970		49090
AC =	7	16942		47002
PC =	7	18972		49092
AC =	8	16944		47004
PC =	8	18974		49094
AC =	9	16946		47006
PC =	9	18976		49096
AC =	10	16948		47008
PC =	10	18978		49098
AC =	11	16950		47010
PC =	11	18980		49100
AC =	12	16952		47012

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*				Nivel
		PC =	12	18982	49102	
		AC =	13	16954	47014	
		PC =	13	18984	49104	
		AC =	14	16956	47016	
		PC =	14	18986	49106	
99	ABC_99	ERROR ID 99. 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*:** **AC - PC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	16960		47020
PC =	1	18930		49050
AC =	2	16962		47022
PC =	2	18932		49052
AC =	3	16964		47024
PC =	3	18934		49054
AC =	4	16966		47026
PC =	4	18936		49056
AC =	5	16968		47028
PC =	5	18938		49058
AC =	6	16970		47030
PC =	6	18940		49060
AC =	7	16972		47032
PC =	7	18942		49062
AC =	8	16974		47034
PC =	8	18944		49064
AC =	9	16976		47036
PC =	9	18946		49066
AC =	10	16978		47038
PC =	10	18948		49068
AC =	11	16980		47040
PC =	11	18950		49070
AC =	12	16982		47042
PC =	12	18952		49072
AC =	13	16984		47044

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	13	18954	49074
AC =	14	16986	47046
PC =	14	18956	49076

100 ABC_100

ERROR ID 100. 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

Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16990		36930		47110		116810
PC =	1	19080		39020		49200		118900
AC =	2	16992		36932		47112		116812
PC =	2	19082		39022		49202		118902
AC =	3	16994		36934		47114		116814
PC =	3	19084		39024		49204		118904
AC =	4	16996		36936		47116		116816
PC =	4	19086		39026		49206		118906
AC =	5	16998		36938		47118		116818
PC =	5	19088		39028		49208		118908
AC =	6	17000		36940		47120		116820
PC =	6	19090		39030		49210		118910
AC =	7	17002		36942		47122		116822
PC =	7	19092		39032		49212		118912
AC =	8	17004		36944		47124		116824
PC =	8	19094		39034		49214		118914
AC =	9	17006		36946		47126		116826
PC =	9	19096		39036		49216		118916
AC =	10	17008		36948		47128		116828
PC =	10	19098		39038		49218		118918
AC =	11	17010		36950		47130		116830
PC =	11	19100		39040		49220		118920
AC =	12	17012		36952		47132		116832
PC =	12	19102		39042		49222		118922
AC =	13	17014		36954		47134		116834

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	13	19104	39044	49224	118924
AC =	14	17016	36956	47136	116836
PC =	14	19106	39046	49226	118926

101 ABC_101 ERROR ID 101. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	17020		36960		47140		116840
PC =	1	19050		38990		49170		118870
AC =	2	17022		36962		47142		116842
PC =	2	19052		38992		49172		118872
AC =	3	17024		36964		47144		116844
PC =	3	19054		38994		49174		118874
AC =	4	17026		36966		47146		116846
PC =	4	19056		38996		49176		118876
AC =	5	17028		36968		47148		116848
PC =	5	19058		38998		49178		118878
AC =	6	17030		36970		47150		116850
PC =	6	19060		39000		49180		118880
AC =	7	17032		36972		47152		116852
PC =	7	19062		39002		49182		118882
AC =	8	17034		36974		47154		116854
PC =	8	19064		39004		49184		118884
AC =	9	17036		36976		47156		116856
PC =	9	19066		39006		49186		118886
AC =	10	17038		36978		47158		116858
PC =	10	19068		39008		49188		118888
AC =	11	17040		36980		47160		116860
PC =	11	19070		39010		49190		118890
AC =	12	17042		36982		47162		116862
PC =	12	19072		39012		49192		118892
AC =	13	17044		36984		47164		116864
PC =	13	19074		39014		49194		118894

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

AC =	14	17046	36986	47166	116866
PC =	14	19076	39016	49196	118896

102 ABC_102 ERROR ID 102. 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

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	17050		36990		47170		116870
PC =	1	19020		38960		49140		118840
AC =	2	17052		36992		47172		116872
PC =	2	19022		38962		49142		118842
AC =	3	17054		36994		47174		116874
PC =	3	19024		38964		49144		118844
AC =	4	17056		36996		47176		116876
PC =	4	19026		38966		49146		118846
AC =	5	17058		36998		47178		116878
PC =	5	19028		38968		49148		118848
AC =	6	17060		37000		47180		116880
PC =	6	19030		38970		49150		118850
AC =	7	17062		37002		47182		116882
PC =	7	19032		38972		49152		118852
AC =	8	17064		37004		47184		116884
PC =	8	19034		38974		49154		118854
AC =	9	17066		37006		47186		116886
PC =	9	19036		38976		49156		118856
AC =	10	17068		37008		47188		116888
PC =	10	19038		38978		49158		118858
AC =	11	17070		37010		47190		116890
PC =	11	19040		38980		49160		118860
AC =	12	17072		37012		47192		116892
PC =	12	19042		38982		49162		118862
AC =	13	17074		37014		47194		116894
PC =	13	19044		38984		49164		118864
AC =	14	17076		37016		47196		116896

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

PC =	14	19046	38986	49166	118866

103 ABC_103 ERROR ID 103. 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 — Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	17080		37020		47200		116900
PC =	1	18990		38930		49110		118810
AC =	2	17082		37022		47202		116902
PC =	2	18992		38932		49112		118812
AC =	3	17084		37024		47204		116904
PC =	3	18994		38934		49114		118814
AC =	4	17086		37026		47206		116906
PC =	4	18996		38936		49116		118816
AC =	5	17088		37028		47208		116908
PC =	5	18998		38938		49118		118818
AC =	6	17090		37030		47210		116910
PC =	6	19000		38940		49120		118820
AC =	7	17092		37032		47212		116912
PC =	7	19002		38942		49122		118822
AC =	8	17094		37034		47214		116914
PC =	8	19004		38944		49124		118824
AC =	9	17096		37036		47216		116916
PC =	9	19006		38946		49126		118826
AC =	10	17098		37038		47218		116918
PC =	10	19008		38948		49128		118828
AC =	11	17100		37040		47220		116920
PC =	11	19010		38950		49130		118830
AC =	12	17102		37042		47222		116922
PC =	12	19012		38952		49132		118832
AC =	13	17104		37044		47224		116924
PC =	13	19014		38954		49134		118834
AC =	14	17106		37046		47226		116926
PC =	14	19016		38956		49136		118836

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
104	ABC_104	ERROR ID 104. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL, (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO PRINCIPAL	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16750		36750		46810		116750
PC =	1	18750		38750		48810		118750
AC =	2	16752		36752		46812		116752
PC =	2	18752		38752		48812		118752
AC =	3	16754		36754		46814		116754
PC =	3	18754		38754		48814		118754
AC =	4	16756		36756		46816		116756
PC =	4	18756		38756		48816		118756
AC =	5	16758		36758		46818		116758
PC =	5	18758		38758		48818		118758
AC =	6	16760		36760		46820		116760
PC =	6	18760		38760		48820		118760
AC =	7	16762		36762		46822		116762
PC =	7	18762		38762		48822		118762
AC =	8	16764		36764		46824		116764
PC =	8	18764		38764		48824		118764
AC =	9	16766		36766		46826		116766
PC =	9	18766		38766		48826		118766
AC =	10	16768		36768		46828		116768
PC =	10	18768		38768		48828		118768
AC =	11	16770		36770		46830		116770
PC =	11	18770		38770		48830		118770
AC =	12	16772		36772		46832		116772
PC =	12	18772		38772		48832		118772
AC =	13	16774		36774		46834		116774
PC =	13	18774		38774		48834		118774
AC =	14	16776		36776		46836		116776
PC =	14	18776		38776		48836		118776

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
105	ABC_105	ERROR ID 105. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO, (PC) COMPENSACIONES DE OPERACIONES ESTRUCTURADAS CONTRATO DERIVADO	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04	Ó	RC11
AC =	1	16780		36780		46840		116780
PC =	1	18780		38780		48840		118780
AC =	2	16782		36782		46842		116782
PC =	2	18782		38782		48842		118782
AC =	3	16784		36784		46844		116784
PC =	3	18784		38784		48844		118784
AC =	4	16786		36786		46846		116786
PC =	4	18786		38786		48846		118786
AC =	5	16788		36788		46848		116788
PC =	5	18788		38788		48848		118788
AC =	6	16790		36790		46850		116790
PC =	6	18790		38790		48850		118790
AC =	7	16792		36792		46852		116792
PC =	7	18792		38792		48852		118792
AC =	8	16794		36794		46854		116794
PC =	8	18794		38794		48854		118794
AC =	9	16796		36796		46856		116796
PC =	9	18796		38796		48856		118796
AC =	10	16798		36798		46858		116798
PC =	10	18798		38798		48858		118798
AC =	11	16800		36800		46860		116800
PC =	11	18800		38800		48860		118800
AC =	12	16802		36802		46862		116802
PC =	12	18802		38802		48862		118802
AC =	13	16804		36804		46864		116804
PC =	13	18804		38804		48864		118804
AC =	14	16806		36806		46866		116806
PC =	14	18806		38806		48866		118806

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
107	ABC_107	ERROR ID 107. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC03	Ó	RC04
AC =	1	17110		37050		47230
PC =	1	19140		39050		49260
AC =	2	17112		37052		47232
PC =	2	19142		39052		49262
AC =	3	17114		37054		47234
PC =	3	19144		39054		49264
AC =	4	17116		37056		47236
PC =	4	19146		39056		49266
AC =	5	17118		37058		47238
PC =	5	19148		39058		49268
AC =	6	17120		37060		47240
PC =	6	19150		39060		49270
AC =	7	17122		37062		47242
PC =	7	19152		39062		49272
AC =	8	17124		37064		47244
PC =	8	19154		39064		49274
AC =	9	17126		37066		47246
PC =	9	19156		39066		49276
AC =	10	17128		37068		47248
PC =	10	19158		39068		49278
AC =	11	17130		37070		47250
PC =	11	19160		39070		49280
AC =	12	17132		37072		47252
PC =	12	19162		39072		49282
AC =	13	17134		37074		47254
PC =	13	19164		39074		49284
AC =	14	17136		37076		47256
PC =	14	19166		39076		49286

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
108	ABC_108	ERROR ID 108. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE VENTA DE BONOS A TASA FIJA, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS DE COMPRA DE BONOS A TASA FIJA	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01	Ó	RC04
AC =	1	17140		47260
PC =	1	19110		49230
AC =	2	17142		47262
PC =	2	19112		49232
AC =	3	17144		47264
PC =	3	19114		49234
AC =	4	17146		47266
PC =	4	19116		49236
AC =	5	17148		47268
PC =	5	19118		49238
AC =	6	17150		47270
PC =	6	19120		49240
AC =	7	17152		47272
PC =	7	19122		49242
AC =	8	17154		47274
PC =	8	19124		49244
AC =	9	17156		47276
PC =	9	19126		49246
AC =	10	17158		47278
PC =	10	19128		49248
AC =	11	17160		47280
PC =	11	19130		49250
AC =	12	17162		47282
PC =	12	19132		49252
AC =	13	17164		47284
PC =	13	19134		49254
AC =	14	17166		47286
PC =	14	19136		49256

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
109	ABC_109	ERROR ID 109. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL ***Algoritmo*:** **AC - PC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AC =	1	17200
PC =	1	19230
AC =	2	17202
PC =	2	19232
AC =	3	17204
PC =	3	19234
AC =	4	17206
PC =	4	19236
AC =	5	17208
PC =	5	19238
AC =	6	17210
PC =	6	19240
AC =	7	17212
PC =	7	19242
AC =	8	17214
PC =	8	19244
AC =	9	17216
PC =	9	19246
AC =	10	17218
PC =	10	19248
AC =	11	17220
PC =	11	19250
AC =	12	17222
PC =	12	19252
AC =	13	17224
PC =	13	19254
AC =	14	17226
PC =	14	19256

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
110	ABC_110	ERROR ID 110. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE COMPRA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL, (PC) COMPENSACIONES DE FUTUROS DE VENTA DE SWAPS DE TASA DE INTERÉS NOMINAL ***Algoritmo*:** **AC - PC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC01
AC =	1	17230
PC =	1	19200
AC =	2	17232
PC =	2	19202
AC =	3	17234
PC =	3	19204
AC =	4	17236
PC =	4	19206
AC =	5	17238
PC =	5	19208
AC =	6	17240
PC =	6	19210
AC =	7	17242
PC =	7	19212
AC =	8	17244
PC =	8	19214
AC =	9	17246
PC =	9	19216
AC =	10	17248
PC =	10	19218
AC =	11	17250
PC =	11	19220
AC =	12	17252
PC =	12	19222
AC =	13	17254
PC =	13	19224
AC =	14	17256
PC =	14	19226

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
111	ABC_111	ERROR ID 111. 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	Grave

***Algoritmo*:**

AC - PC >=0
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:

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
AC =	1	46300
PC =	1	48330
AC =	2	46302
PC =	2	48332
AC =	3	46304
PC =	3	48334
AC =	4	46306
PC =	4	48336
AC =	5	46308
PC =	5	48338
AC =	6	46310
PC =	6	48340
AC =	7	46312
PC =	7	48342
AC =	8	46314
PC =	8	48344
AC =	9	46316
PC =	9	48346
AC =	10	46318
PC =	10	48348
AC =	11	46320
PC =	11	48350
AC =	12	46322
PC =	12	48352
AC =	13	46324
PC =	13	48354
AC =	14	46326
PC =	14	48356

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
112	ABC_112	ERROR ID 112. VALIDACIÓN TIPO [(AC) ACTIVO COMPENSABLE, (PC) PASIVO COMPENSABLE]. CONCEPTOS: (AC) COMPENSACIONES DE OPCIONES TENENCIA DE VENTA SOBRE DE DIVISAS, (PC) COMPENSACIONES DE OPCIONES DE EMISIÓN DE VENTA SOBRE DIVISAS ***Algoritmo*:** **AC - PC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
AC =	1	47050
PC =	1	49020
AC =	2	47052
PC =	2	49022
AC =	3	47054
PC =	3	49024
AC =	4	47056
PC =	4	49026
AC =	5	47058
PC =	5	49028
AC =	6	47060
PC =	6	49030
AC =	7	47062
PC =	7	49032
AC =	8	47064
PC =	8	49034
AC =	9	47066
PC =	9	49036
AC =	10	47068
PC =	10	49038
AC =	11	47070
PC =	11	49040
AC =	12	47072
PC =	12	49042
AC =	13	47074
PC =	13	49044
AC =	14	47076
PC =	14	49046

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
113	ABC_113	ERROR ID 113. 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*:** **AC - PC >=0** **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

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	BANDA	RC04
AC =	1	47080
PC =	1	48990
AC =	2	47082
PC =	2	48992
AC =	3	47084
PC =	3	48994
AC =	4	47086
PC =	4	48996
AC =	5	47088
PC =	5	48998
AC =	6	47090
PC =	6	49000
AC =	7	47092
PC =	7	49002
AC =	8	47094
PC =	8	49004
AC =	9	47096
PC =	9	49006
AC =	10	47098
PC =	10	49008
AC =	11	47100
PC =	11	49010
AC =	12	47102
PC =	12	49012
AC =	13	47104
PC =	13	49014
AC =	14	47106
PC =	14	49016

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
114	ABC_114	ERROR 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	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I AL IX, XI AL XIII y XVII. PARA LAS OPERACIONES X Y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60010	<=	60020	+	60030
	Ó					
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60310	<=	60320	+	60330
	Ó					
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60610	<=	60620	+	60630
	Ó					
IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61510	<=	61520	+	61530
	Ó					
V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61810	<=	61820	+	61830
	Ó					
VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62110	<=	62120	+	62130
	Ó					
VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62410	<=	62420	+	62430
	Ó					
VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63310	<=	63320	+	63330
	Ó					
IX	"FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63610	<=	63620	+	63630
	Ó					
X	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	63910	<=	0	+	63930
	Ó					
XI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64210	<=	64220	+	64230
	Ó					
XII	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64510	<=	64520	+	64530

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		Ó						
XIII	OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68010	<=	68020	+	68030		
		Ó						
XVI	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69300	<=	0	+	69310		
		Ó						
XVII	COMPRA-VENTA AL CONTADO DE DIVISAS Y TÍTULOS	69450	<=	69460	+	69470		

115 ABC_115 ERROR ID 115 VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO [...I - XVII...] DEL GRUPO I, DEB SER ACTIVO A RECIBIR = (PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS + IMPORTE POSITIVO) — Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I AL IX, XI AL XIII y XVII. PARA LAS OPERACIONES X Y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60061	<=	60071	+	60081	+	60091
	Ó							
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60361	<=	60371	+	60381	+	60391
	Ó							
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60661	<=	60671	+	60681	+	60691
	Ó							
IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61561	<=	61571	+	61581	+	61591
	Ó							
V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61861	<=	61871	+	61881	+	61891
	Ó							
VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62161	<=	62171	+	62181	+	62191
	Ó							
VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62461	<=	62471	+	62481	+	62491
	Ó							
VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63361	<=	63371	+	63381	+	63391

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*								Nivel
		Ó								
		IX "FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63661	<=	63671	+	63681	+	63691	
		Ó								
		X PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	63961	<=	0	+	63981	+	63991	
		Ó								
		XI TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64261	<=	64271	+	64281	+	64291	
		Ó								
		XII TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64561	<=	64571	+	64581	+	64591	
		Ó								
		XIII OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68061	<=	68071	+	68081	+	68091	
		Ó								
		XVI PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69320	<=	0	+	69330	+	69340	
		Ó								
		XVII COMPRA-VENTA AL CONTADO DE DIVISAS Y TÍTULOS	69480	<=	69490	+	69500	+	69510	
116	ABC_116	ERROR ID 116. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...I - XVI...] DEL GRUPO II, DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS								Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I al IX, XI al XV. PARA LAS OPERACIONES X y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60110	<=	60120	+	60130
	Ó					
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60410	<=	60420	+	60430
	Ó					
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60710	<=	60720	+	60730
	Ó					
IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61610	<=	61620	+	61630
	Ó					
V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61910	<=	61920	+	61930
	Ó					

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62210	<=	62220	+	62230
	Ó					
VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62510	<=	62520	+	62530
	Ó					
VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63410	<=	63420	+	63430
	Ó					
IX	"FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63710	<=	63720	+	63730
	Ó					
X	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	64010	<=	0	+	64030
	Ó					
XI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64310	<=	64320	+	64330
	Ó					
XII	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64610	<=	64620	+	64630
	Ó					
XIII	OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68110	<=	68120	+	68130
	Ó					
XV	OPERACIONES CON INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN SU NIVEL DE RIESGO CONFORME A LA CALIDAD CREDITICIA OTROGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS DE VALORES	69110	<=	69120	+	69130
	Ó					
XVI	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69350	<=	0	+	69360

117 ABC_117 ERROR ID 117 VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO [...I - XVI...] DEL GRUPO II, DEB SER ACTIVO A RECIBIR = (PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS + IMPORTE POSITIVO) — Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I al IX, XI al XV. PARA LAS OPERACIONES X y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60162	<=	60172	+	60182	+	60192
	Ó							
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60462	<=	60472	+	60482	+	60492
	Ó							
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60762	<=	60772	+	60782	+	60792

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*								Nivel
			Ó							
		IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61662	<=	61672	+	61682	+	61692
			Ó							
		V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61962	<=	61972	+	61982	+	61992
			Ó							
		VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62262	<=	62272	+	62282	+	62292
			Ó							
		VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62562	<=	62572	+	62582	+	62592
			Ó							
		VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63462	<=	63472	+	63482	+	63492
			Ó							
		IX	"FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63762	<=	63772	+	63782	+	63792
			Ó							
		X	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	64062	<=	0	+	64082	+	64092
			Ó							
		XI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64362	<=	64372	+	64382	+	64392
			Ó							
		XII	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64662	<=	64672	+	64682	+	64692
			Ó							
		XIII	OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68162	<=	68172	+	68182	+	68192
			Ó							
		XV	OPERACIONES CON INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN SU NIVEL DE RIESGO CONFORME A LA CALIDAD CREDITICIA OTROGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS DE VALORES	69115	<=	69225	+	69235	+	69245
			Ó							
		XVI	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69370	<=	0	+	69380	+	69390

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
118	ABC_118	ERROR ID 118. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...I - XVI...] DEL GRUPO III, DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I al IX, XI al XIV. PARA LAS OPERACIONES X y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60210	<=	60220	+	60230
	Ó					
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60510	<=	60520	+	60530
	Ó					
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60810	<=	60820	+	60830
	Ó					
IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61710	<=	61720	+	61730
	Ó					
V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62010	<=	62020	+	62030
	Ó					
VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62310	<=	62320	+	62330
	Ó					
VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62610	<=	62620	+	62630
	Ó					
VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63510	<=	63520	+	63530
	Ó					
IX	"FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63810	<=	63820	+	63830
	Ó					
X	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	64110	<=	0	+	64130
	Ó					
XI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64410	<=	64420	+	64430
	Ó					
XII	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64710	<=	64720	+	64730
	Ó					
XIII	OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68210	<=	68220	+	68230
	Ó					
XVI	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69400	<=	0	+	69410

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
119	ABC_119	ERROR ID 119 VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO [...I - XVI...] DEL GRUPO III, DEB SER ACTIVO A RECIBIR = (PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS + IMPORTE POSITIVO)	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES I al IX, XI al XIV. PARA LAS OPERACIONES X y XVI NO APLICA LOS PASIVOS A ENTREGAR. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
I	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADOR, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60263	<=	60273	+	60283	+	60293
	Ó							
II	OPERACIONES DE REPORTO ACTUANDO COMO REPORTADO, CELEBRADAS CON PERSONAS:	60563	<=	60573	+	60583	+	60593
	Ó							
III	INTERCAMBIOS DE FLUJOS DE DINERO (SWAPS), CELEBRADOS CON PERSONAS:	60863	<=	60873	+	60883	+	60893
	Ó							
IV	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	61763	<=	61773	+	61783	+	61793
	Ó							
V	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62063	<=	62073	+	62083	+	62093
	Ó							
VI	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62363	<=	62373	+	62383	+	62393
	Ó							
VII	CONTRATOS ADELANTADOS ("FORWARDS") Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERÉS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	62663	<=	62673	+	62683	+	62693
	Ó							
VIII	"FORWARDS" Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63563	<=	63573	+	63583	+	63593
	Ó							
IX	"FORWARDS" Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISTINTOS A TASAS DE INTERÉS Y DIVISAS, CELEBRADOS CON PERSONAS:	63863	<=	63873	+	63883	+	63893
	Ó							
X	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTAMISTA, OTORGADOS A PERSONAS:	64163	<=	0	+	64183	+	64193
	Ó							
XI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64463	<=	64473	+	64483	+	64493
	Ó							
XII	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, EMITIDOS POR PERSONAS:	64763	<=	64773	+	64783	+	64793

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		Ó							
XIII	OPERACIONES DE REPORTO Y DERIVADAS REALIZADAS POR PARTE DEL "FONDO DE RESERVA" DE LA INSTITUCIÓN, CELEBRADAS CON PERSONAS DE LAS COMPRENDIDAS EN EL:	68263	<=	68273	+	68283	+	68293
	Ó								
XVI	PRÉSTAMOS DE VALORES ACTUANDO COMO PRESTATARIO, OTORGADOS A PERSONAS:	69420	<=	0	+	69430	+	69440

120 ABC_120

ERROR ID 120 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Grave

***Algoritmo*:**

APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70202	<=	70002
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71202	<=	71002
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73202	<=	73002
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75202	<=	75002
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75289	<=	75089

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>121</td><td>ABC_121</td><td>ERROR ID 121 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70205	<=	70005
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71205	<=	71005
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73205	<=	73005
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75205	<=	75005
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75290	<=	75090

<table>
<tr><td>122</td><td>ABC_122</td><td>ERROR ID 122 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70207	<=	70007
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71207	<=	71007
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73207	<=	73007
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75207	<=	75007
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75291	<=	75091

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>123</td><td>ABC_123</td><td>ERROR ID 123 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>124</td><td>ABC_124</td><td>ERROR ID 124 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS "OTROS GRUPO I.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70210	<=	70010
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71210	<=	71010
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73210	<=	73010
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75210	<=	75010
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75292	<=	75092

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70211	<=	70011
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71211	<=	71011
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74211	<=	74011

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
125	ABC_125	ERROR ID 125 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS "OTROS GRUPO II.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70222	<=	70022
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71222	<=	71022
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74222	<=	74022

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
126	ABC_126	ERROR ID 126 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS "OTROS GRUPO III.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70233	<=	70033
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71233	<=	71033
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74233	<=	74033

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>129</td><td>ABC_129</td><td>ERROR ID 129 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO I.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS
Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73211	<=	73011
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL	75211	<=	75011

<table>
<tr><td>130</td><td>ABC_130</td><td>ERROR ID 130 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO II.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS
Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73222	<=	73022
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL	75222	<=	75022

<table>
<tr><td>131</td><td>ABC_131</td><td>ERROR ID 131 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO III.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS
Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73233	<=	73033
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL	75233	<=	75033

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>134</td><td>ABC_134</td><td>ERROR ID 134 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO I.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73291</td><td><=</td><td>73091</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME</td><td>75293</td><td><=</td><td>75093</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>135</td><td>ABC_135</td><td>ERROR ID 135 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO II.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73292</td><td><=</td><td>73092</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME</td><td>75294</td><td><=</td><td>75094</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>136</td><td>ABC_136</td><td>ERROR ID 136 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO III.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO 2</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73293	<=	73093
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75295	<=	75095

<table>
<tr><td>139</td><td>ABC_139</td><td>ERROR ID 139 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 EMISIONES DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN OBLIGATORIA EN TÍTULOS REPRESENTATIVOS DE CAPITAL SOCIAL DE LA INSTITUCIÓN QUE CUMPLEN CON LOS CRITERIOS DEL ART. 163 DE LA CUB, DEBE SER LA SUMA DE [COMPUTABLES COMO CAPITAL BÁSICO + COMPUTABLES COMO CAPITAL COMPLEMENTARIO + NO COMPUTABLES COMO CAPITAL]</td><td>Grave</td></tr>
</table>

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	9105
B =	91005
B =	91010
B =	91015

<table>
<tr><td>140</td><td>ABC_140</td><td>ERROR ID 140 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 EMISIONES DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS DE CONVERSIÓN OBLIGATOTIA EN TÍTULOS REPRESENTATIVOS DEL CAPITAL SOCIAL DE LA INSTITUCIÓN QUE NO CUMPLEN CON LOS CRITERIOS DEL ART. 163 DE LA CUB, DEBE SER LA SUMA DE [COMPUTABLES COMO CAPITAL COMPLEMENTARIO + NO COMPUTABLES COMO CAPITAL]</td><td>Grave</td></tr>
</table>

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	9110
B =	90660
B =	90665

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
141	ABC_141	ERROR ID 141 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 EMISIONES DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS NO CONVERTIBLES Y DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA, DEBE SER LA SUMA DE [COMPUTABLES COMO CAPITAL COMPLEMENTARIO + NO COMPUTABLES COMO CAPITAL]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	9115
B =	90670
B =	90675

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
142	ABC_142	ERROR ID 142 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 OBLIGACIONES SUBORDINADAS EMITIDAS POR OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS Y POR SOCIEDADES CONTROLADORAS DE GRUPOS FINANCIEROS, DEBE SER LA SUMA DE [DE CONVERSIÓN OBLIGATOTIA + NO CONVERTIBLES Y DE CONVERSIÓN VOLUNTARIA]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	91950
B =	92000
B =	92050

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
143	ABC_143	ERROR ID 143 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09: INVERSIONES EN INSTRUMENTOS DE DEUDA, RELATIVOS A ESQUEMAS DE BURSATILIZACIÓN, DEBE SER LA SUMA DE [DE HIPOTECAS + OTRO TIPO DE CARTERA]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	92071
B =	92075
B =	92079

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
144	ABC_144	ERROR ID 144 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 INVERSIONES EN ACCIONES DE ENTIDADES FINANCIERAS Y CONTROLADORAS, DEBE SER LA SUMA DE [SOCIEDADES Y FONDOS DE INVERSIÓN, PARTE RELATIVA AL CAPITAL FIJO (INCLUYE LA INVERSIÓN DE CONTROLADORAS DE SOCIEDADES DE INVERSIÓN) + CONTROLADORAS DE GRUPOS FINANCIEROS + ENTIDADES FINANCIERAS DEL PAÍS + ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR + CAMARÁS DE COMPENSACIÓN]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	92140
B =	92150
B =	92200
B =	92250
B =	92300
B =	92350

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
145	ABC_145	ERROR ID 145 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 INVERSIONES EN ACCIONES DE ENTIDADES FINANCIERAS Y CONTROLADORAS, ENTIDADES FINANCIERAS DEL PAÍS, DEBE SER LA SUMA DE [ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE FONDOS PARA EL RETIRO Y SOCIEDADES DE INVERSIÓN ESPECIALIZADAS DE FONDOS PARA EL RETIRO + OTRAS]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	92250
B =	92255
B =	92260

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
146	ABC_146	ERROR ID 146 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 INVERSIONES EN ACCIONES DE ENTIDADES FINANCIERAS Y CONTROLADORAS, ENTIDADES FINANCIERAS DEL EXTERIOR, DEBE SER LA SUMA DE [INVERSIONES INDIRECTAS + INVERSIONES INDIRECTAS (REALIZADAS A TRAVÉS DE ENTIDADES FINANCIERAS O CONTROLADORAS, FILIALES DIRECTAS DE LA INSTITUCIÓN)]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	92300
B =	92305
B =	92310

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
147	ABC_147	ERROR ID 147 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 ISR y PTU DIFERIDOS, DEBE SER LA SUMA DE [PROVENIENTES DE PÉRDIDAS FISCALES + PROVENIENTES DE LA CONSTITUCIÓN DE RESERVAS EN EXCESO DEL LÍMITE FISCAL]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	93500
B =	93510
B =	93520

148	ABC_148	ERROR ID 148 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 PARTIDAS QUE 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 RECONOCIMIENTOEN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	93700
B =	93720
B =	93730
B =	93750

149	ABC_149	ERROR ID 149 VALIDACIÓN SECCIÓN 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]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	93730
B =	93733
B =	93736

150	ABC_150	ERROR ID 150 VALIDACIÓN SECCIÓN RC09 EROGACIONES O GASTOS CUYO RECONOCIMIENTO EN EL CAPITAL CONTABLE SE DIFIERA EN EL TIEMPO, DEBE SER LA SUMA [RELATIVOS A LOS ACTIVOS FIJOS Y A LOS PAGOS ANTICIPADOS MENORES A UN AÑO + RELATIVOS A OTROS]	Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC09
A =	93750

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		B = 93755 B = 93758	
151	ABC_151	ERROR ID 151 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN NETA DEL PORTAFOLIO POSITIVA (52200). EL IMPORTE POSITIVO RESULTANTE DE LA DIFERENCIA ENTRE LA POSICIÓN TOTAL LARGA (CONCEPTO 52100) Y LA POSICIÓN TOTAL CORTA (CONCEPTO 52150) **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC05** A = 52100 B = 52150 B = 52200	Grave
152	ABC_152	ERROR ID 152 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN NETA DEL PORTAFOLIO NEGATIVA (52250). EL VALOR ABSOLUTO DEL IMPORTE NEGATIVO RESULTANTE DE LA DIFERENCIA ENTRE LA POSICIÓN TOTAL LARGA (CONCEPTO 52100) Y LA POSICIÓN TOTAL CORTA (CONCEPTO 52150) **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC05** A = 52150 B = 52100 B = 52250	Grave
153	ABC_153	ERROR ID 153 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN TOTAL LARGA (52100). SUMATORIA DE LAS POSICIONES NETAS LARGAS POR CADA SERIE ACCIONARIA (SUMATORIA DE LOS CONCEPTOS: 50050, 50100, 50110, 50115, 50150, 50200, 50250, 50255, 50300, 50350, 50400, 50550, 50600, 50650, 50900 MENOS EL CONCEPTO: 52050) **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC05** A = 50050 A = 50100 A = 50110 A = 50115 A = 50150 A = 50200 A = 50250 A = 50255 A = 50300 A = 50350 A = 50400 A = 50550 A = 50600 A = 50650 A = 50900	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

B =	52100
B =	52050

154 ABC_154 ERROR ID 154 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN TOTAL CORTA (52150). SUMATORIA DE LAS POSICIONES NETAS CORTAS POR CADA SERIE ACCIONARIA (SUMATORIA DE LOS CONCEPTOS: 51050, 51150, 51200, 51250, 51255, 51300, 51350, 51400, 51550, 51600, 51650, 51900 MENOS EL CONCEPTO: 52050) Grave

ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC05
A =	51050
A =	51150
A =	51200
A =	51250
A =	51255
A =	51300
A =	51350
A =	51400
A =	51550
A =	51600
A =	51650
A =	51900
B =	52150
B =	52050

155 ABC_155 ERROR ID 155 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS Grave

***Algoritmo*:**

APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTO LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70202	<=	70102
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71202	<=	71102
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73202	<=	73102
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75202	<=	75102
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75289	<=	75189

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>156</td><td>ABC_156</td><td>ERROR ID 156 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70205	<=	70105
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71205	<=	71105
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73205	<=	73105
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75205	<=	75105
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75290	<=	75190

<table>
<tr><td>157</td><td>ABC_157</td><td>ERROR ID 157 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE</td><td>Grave</td></tr>
</table>

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70207	<=	70107
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71207	<=	71107
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73207	<=	73107
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75207	<=	75107
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75291	<=	75191

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
158	ABC_158	ERROR ID 158 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - V] EMITIDOS POR EL GRUPO V CORRESPONDIENTES AL ART. 160 FRACCIÓN V INCISO a).....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA A LOS APARTADOS I al III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70210	<=	70110
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71210	<=	71110
	Ó			
III	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA	73210	<=	73110
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN	75210	<=	75110
	Ó			
V	APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME	75292	<=	75192

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
159	ABC_159	ERROR ID 159 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - IV] EMITIDOS "OTROS GRUPO I.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70211	<=	70111
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71211	<=	71111
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74211	<=	74111

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
160	ABC_160	ERROR ID 160 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - IV] EMITIDOS "OTROS GRUPO II.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70222	<=	70122
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71222	<=	71122
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74222	<=	74122

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
161	ABC_161	ERROR ID 161 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [I - IV] EMITIDOS "OTROS GRUPO III.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA A LOS APARTADOS I, II y IV. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
I	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA NACIONAL (M.N.) CON TASA DE RENDIMIENTO NOMINAL	70233	<=	70133
	Ó			
II	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA EN UNIDADES DE INVERSIÓN (UDIS), O EN M.N. CON TASA DE RENDIMIENTO REAL, O CON TASA REFERIDA AL SALARIO MÍNIMO GENERAL	71233	<=	71133
	Ó			
IV	APARTADO IV.- TÍTULOS DE DEUDA CON OTRO RENDIMIENTO (POR EJEMPLO: REFERIDO AL DE UNA ACCIÓN, UNA CANASTA DE ACCIONES O ÍNDICES ACCIONARIOS; REFERIDO A LA VARIACIÓN DE UN TIPO DE CAMBIO, ETC.)	74233	<=	74133

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>162</td><td>ABC_162</td><td>ERROR ID 162 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO I.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73211</td><td><=</td><td>73111</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN</td><td>75211</td><td><=</td><td>75111</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>163</td><td>ABC_163</td><td>ERROR ID 163 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO II.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73222</td><td><=</td><td>73122</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN</td><td>75222</td><td><=</td><td>75122</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>164</td><td>ABC_164</td><td>ERROR ID 164 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES LA MISMA QUE LA DEL TÍTULO", PERTENECIENTES A GRUPO III.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73233</td><td><=</td><td>73133</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL MN</td><td>75233</td><td><=</td><td>75133</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>165</td><td>ABC_165</td><td>ERROR ID 165 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO I.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73291</td><td><=</td><td>73191</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME</td><td>75293</td><td><=</td><td>75193</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>166</td><td>ABC_166</td><td>ERROR ID 166 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO II.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73292</td><td><=</td><td>73192</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME</td><td>75294</td><td><=</td><td>75194</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>167</td><td>ABC_167</td><td>ERROR ID 167 VALIDACIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [III - V] EMITIDOS "OTRAS PERSONAS QUE RESIDEN EN PAÍSES CUYA MONEDA ES DISTINTA QUE LA DEL TÍTULO", PERSONAS DISTINTAS A LAS COMPRENDIDAS EN EL SEGUNDO PÁRRAFO ART. 73 PERTENECIENTE A GRUPO III.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS III y V. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>III</td><td>APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA EN MONEDA EXTRANJERA</td><td>73293</td><td><=</td><td>73193</td></tr>
<tr><td colspan="5">Ó</td></tr>
<tr><td>V</td><td>APARTADO V.- TÍTULOS DE DEUDA RELATIVOS A LAS INVERSIONES DEL FONDO DE RESERVA DEL PERSONAL ME</td><td>75295</td><td><=</td><td>75195</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>168</td><td>ABC_168</td><td>ERROR ID 168 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [VI] EMITIDOS POR EL GRUPO II QUE NO REVELEN SU GRADO DE RIESGO a).....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS VI. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>VI</td><td>APARTADO VI.- TÍTULOS DE DEUDA EMITIDOS POR INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN SU NIVEL DE RIESGO CONFORME A LA CALIDAD CREDITICIA OTORGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS DE VALORES</td><td>76225</td><td><=</td><td>76005</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>169</td><td>ABC_169</td><td>ERROR ID 169 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO [VI] EMITIDOS POR EL GRUPO II QUE NO REVELEN SU GRADO DE RIESGO a).....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA A LOS APARTADOS VI. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>VI</td><td>APARTADO VI.- TÍTULOS DE DEUDA EMITIDOS POR INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN SU NIVEL DE RIESGO CONFORME A LA CALIDAD CREDITICIA OTORGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS DE VALORES</td><td>76225</td><td><=</td><td>76125</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>170</td><td>ABC_170</td><td>ERROR ID 170 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN TOTAL LARGA DE CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS, INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS (55100). SUMATORIA DE LA POSICION LARGA POR CADA SERIE ACCIONARIA (CONCEPTO: 50700 MENOS EL CONCEPTO: 55050)

Algoritmo:
PARA LOS ELEMENTOS A DE LA VALIDACIÓN SE DEBEN CONSIDERAR LOS IMPORTES 1 Y 2 DE LA SECCIÓN RC05

<table>
<tr><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC05</th></tr>
<tr><td>A =</td><td>50700</td></tr>
<tr><td>B =</td><td>55100</td></tr>
<tr><td>B =</td><td>55050</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>171</td><td>ABC_171</td><td>ERROR ID 171 VALIDACIÓN SECCIÓN RC05 POSICIÓN TOTAL CORTA DE CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS, INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS (55150). SUMATORIA DE LA POSICION CORTA POR CADA SERIE ACCIONARIA (CONCEPTO: 51700 MENOS EL CONCEPTO: 55050)

Algoritmo:
PARA LOS ELEMENTOS A DE LA VALIDACIÓN SE DEBEN CONSIDERAR LOS IMPORTES 1 Y 2 DE LA SECCIÓN RC05

<table>
<tr><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC05</th></tr>
<tr><td>A =</td><td>51700</td></tr>
<tr><td>B =</td><td>55150</td></tr>
<tr><td>B =</td><td>55050</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>172</td><td>ABC_172</td><td>ERROR ID 172 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS EMITIDOS "OTRAS GRUPO I.[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>VII</td><td>APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS</td><td>77211</td><td><=</td><td>77011</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>173</td><td>ABC_173</td><td>ERROR ID 173 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO II.[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>VII</td><td>APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS</td><td>77222</td><td><=</td><td>77022</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
174	ABC_174	ERROR ID 174 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO III.[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
VII	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77233	<=	77033

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
175	ABC_175	ERROR ID 175 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS EMITIDOS "OTRAS GRUPO I.[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
VII	APARTADO I.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77211	<=	77111

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
176	ABC_176	ERROR ID 176 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO II.[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
VII	APARTADO II.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77222	<=	77122

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
177	ABC_177	ERROR ID 177 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO III.[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
VII	APARTADO III.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77233	<=	77133

191	ABC_191	ERROR ID 191 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO A)...[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
VII	ART. 160 FRACCIÓN V INCISO A).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77223	<=	77002

192	ABC_192	ERROR ID 192 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO B)...[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
VII	ART. 160 FRACCIÓN V INCISO B).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS	77224	<=	77005

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
193	ABC_193	ERROR ID 193 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO C)...[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | | **POSICIONES BRUTAS LARGAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO C).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77227 | <= | 77007	Grave
194	ABC_194	ERROR ID 194 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO D)...[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | | **POSICIONES BRUTAS LARGAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO D).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77230 | <= | 77010	Grave
195	ABC_195	ERROR ID 195 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO A)...[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | | **POSICIONES BRUTAS CORTAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO A).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77223 | <= | 77112	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
196	ABC_196	ERROR ID 196 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO B)...[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | **POSICIONES BRUTAS CORTAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO B).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77224 <= 77115	Grave
197	ABC_197	ERROR ID 197 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO C)...[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | **POSICIONES BRUTAS CORTAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO C).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77227 <= 77117	Grave
198	ABC_198	ERROR ID 198 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "EMITIDOS POR LOS GOBIERNOS DE LOS ESTADOS Y MUNICIPIOS. ARTÍCULO 160 FRACCIÓN V INCISO D)...[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE* **IDENTIFICADOR** | **SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)** | **LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO** | **POSICIONES BRUTAS CORTAS** VII | ART. 160 FRACCIÓN V INCISO D).- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS | 77230 <= 77120	Grave

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>199</td><td>ABC_199</td><td>ERROR ID 199 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO II BIS.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS LARGAS</th></tr>
<tr><td>VII</td><td>APARTADO II BIS.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS</td><td>77225</td><td><=</td><td>77025</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>200</td><td>ABC_200</td><td>ERROR ID 200 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "OTRAS GRUPO II BIS..[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS

Algoritmo:
APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)</th><th>LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO</th><th></th><th>POSICIONES BRUTAS CORTAS</th></tr>
<tr><td>VII</td><td>APARTADO II BIS.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS</td><td>77225</td><td><=</td><td>77125</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>201</td><td>ABC_201</td><td>ERROR ID 201. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO II, DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS

Algoritmo:
APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

<table>
<tr><th>IDENTIFICADOR</th><th>TIPO DE OPERACIÓN</th><th>ACTIVO A RECIBIR</th><th></th><th>PASIVO A ENTREGAR</th><th></th><th>GARANTÍAS RECIBIDAS</th></tr>
<tr><td>XVIII</td><td>SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN</td><td>65070</td><td><=</td><td>65075</td><td>+</td><td>65080</td></tr>
<tr><td></td><td>Ó</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>XIX</td><td>FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:</td><td>65210</td><td><=</td><td>65215</td><td>+</td><td>65220</td></tr>
<tr><td></td><td>Ó</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>XX</td><td>FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:</td><td>65350</td><td><=</td><td>65355</td><td>+</td><td>65360</td></tr>
<tr><td></td><td>Ó</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>XXI</td><td>FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN</td><td>65490</td><td><=</td><td>65495</td><td>+</td><td>65500</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		Ó						
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65630	<=	65635	+	65640
		Ó						
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65770	<=	65775	+	65780
		Ó						
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65910	<=	65915	+	65920
		Ó						
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66050	<=	66055	+	66060
		Ó						
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66190	<=	66195	+	66200

202 ABC_202 ERROR ID 202 VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO II, DEB SER ACTIVO A RECIBIR = (PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS + IMPORTE POSITIVO) — Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65085	=	65090	+	65095	+	65100
	Ó							
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65225	=	65230	+	65235	+	65240
	Ó							
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65365	=	65370	+	65375	+	65380
	Ó							
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65505	=	65510	+	65515	+	65520
	Ó							
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65645	=	65650	+	65655	+	65660
	Ó							
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65785	=	65790	+	65795	+	65800
	Ó							
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE	65925	=	65930	+	65935	+	65940

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

		INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:							
		Ó							
XXV		TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66065	=	66070	+	66075	+	66080
		Ó							
XXVI		TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66205	=	66120	+	66215	+	66220

203 ABC_203 ERROR ID 203. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO III, DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS — Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65105	<=	65110	+	65115
	Ó					
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65245	<=	65250	+	65255
	Ó					
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65385	<=	65390	+	65395
	Ó					
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65525	<=	65530	+	65535
	Ó					
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65665	<=	65670	+	65675
	Ó					
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65805	<=	65810	+	65815
	Ó					
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65945	<=	65950	+	65955
	Ó					

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel

XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66085	<=	66090	+	66095
	Ó					
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66225	<=	66230	+	66235

204 ABC_204 ERROR ID 204 VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO III, DEB SER ACTIVO A RECIBIR = (PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS + IMPORTE POSITIVO) — Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65120	=	65125	+	65130	+	65135
	Ó							
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65260	=	65265	+	65270	+	65275
	Ó							
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65400	=	65405	+	65410	+	65415
	Ó							
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65540	=	65545	+	65550	+	65555
	Ó							
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65680	=	65685	+	65690	+	65695
	Ó							
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65820	=	65825	+	65830	+	65835
	Ó							
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65960	=	66965	+	65970	+	65975
	Ó							
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66100	=	66105	+	66110	+	66115
	Ó							
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE	66240	=	66245	+	66250	+	66255

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
		SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	
205	ABC_205	ERROR ID 205. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO I QUE POND 2 , DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65000	<=	65005	+	65010
	Ó					
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65140	<=	65145	+	65150
	Ó					
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65280	<=	65285	+	65290
	Ó					
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65420	<=	65425	+	65430
	Ó					
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65560	<=	65565	+	65570
	Ó					
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65700	<=	65705	+	65710
	Ó					
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65840	<=	65845	+	65850
	Ó					
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65980	<=	65985	+	65990
	Ó					
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66120	<=	66125	+	66130

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
206	ABC_206	ERROR ID 206. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CON IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO I QUE POND 2 , DEBE SER ACTIVO A RECIBIR = PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS+ IMPORTE POSITIVO	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65015	=	65020	+	65025	+	65030
	Ó							
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65155	=	65160	+	65165	+	65170
	Ó							
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65295	=	65300	+	65305	+	65310
	Ó							
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65435	=	65440	+	65445	+	65450
	Ó							
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65575	=	65580	+	65585	+	65590
	Ó							
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65715	=	65720	+	65725	+	65730
	Ó							
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65855	=	65860	+	65865	+	65870
	Ó							
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65995	=	66000	+	66005	+	66010
	Ó							
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66135	=	66140	+	66145	+	66150

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
207	ABC_207	ERROR ID 207. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES SIN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO I QUE POND 4 , DEBE SER ACTIVO A RECIBIR <= PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS ***Algoritmo*:** *APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO*	Grave

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65035	<=	65040	+	65045
	Ó					
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65175	<=	65180	+	65185
	Ó					
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65315	<=	65320	+	65325
	Ó					
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65455	<=	65460	+	65465
	Ó					
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65595	<=	65600	+	65605
	Ó					
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65735	<=	65740	+	65745
	Ó					
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65875	<=	65880	+	65885
	Ó					
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66015	<=	66020	+	66025
	Ó					
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66155	<=	66160	+	66165

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
208	ABC_208	ERROR ID 208. VALIDACIÓN SECCIÓN RC06 OPERACIONES CONN IMPORTE POSITIVO, OPERACIÓN [...XVIII - XXVI...] DEL GRUPO I QUE POND 4 , DEBE SER ACTIVO A RECIBIR = PASIVO A ENTREGAR + LAS GARANTÍAS RECIBIDAS +IMPORTE POSITIVO	Grave

***Algoritmo*:**

APLICA PARA OPERACIONES XVIII A XXVI TANTO LOS CONCEPTOS COMO LAS OPERACIONES MENCIONADAS SE REFIEREN AL ANEXO 1- CREDITO

IDENTIFICADOR	TIPO DE OPERACIÓN	ACTIVO A RECIBIR		PASIVO A ENTREGAR		GARANTÍAS RECIBIDAS		IMPORTE POSITIVO
XVIII	SWAPS QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65050	=	65055	+	65060	+	65065
	Ó							
XIX	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓ:	65190	=	65195	+	65200	+	65205
	Ó							
XX	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65330	=	65335	+	65340	+	65345
	Ó							
XXI	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN	65470	=	65475	+	65480	+	65485
	Ó							
XXII	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE TASAS DE INTERES, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65610	=	65615	+	65620	+	65625
	Ó							
XXIII	FORWARDS Y FUTUROS DE COMPRA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65750	=	65755	+	65760	+	65765
	Ó							
XXIV	FORWARDS Y FUTUROS DE VENTA DE SUBYACENTES DISITINTOS A TASAS DE INTERES Y DIVISAS, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	65890	=	65895	+	65900	+	65905
	Ó							
XXV	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE COMPRA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN:	66030	=	66035	+	66040	+	66045
	Ó							
XXVI	TENENCIA DE OPCIONES Y TÍTULOS OPCIONALES (WARRANTS) DE VENTA, QUE SE LIQUIDEN CON CÁMARAS DE COMPENSACIÓN DEL GRUPO:	66170	=	66175	+	66180	+	66185

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
209	**ABC_209**	**ERROR ID 209 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "PONDERADOS AL 1250%.....[POSICIONES LARGAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES LARGAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS** *Algoritmo*: *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	**Grave**

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS LARGAS
VII	TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS PONDERADOS AL 1250%	79225	<=	79005

210	ABC_210	ERROR ID 210 VALIDACIÓN SECCIÓN RC07 OPERACIONES DEL APARTADO VII.- TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSATILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS "PONDERADOS AL 1250%.....[POSICIONES CORTAS CONTRA POSICIONES LARGAS Y CORTAS] LAS POSICIONES CORTAS DEBEN SER MAYOR O IGUAL A LARGAS Y CORTAS ***Algoritmo*:** *APLICA AL APARTADO VII. TANTOS LOS CONCEPTOS COMO LOS APARTADOS MENCIONADOS SE REFIEREN AL ANEXO2. APLICA A AMBAS COLUMNAS DE IMPORTE*	Grave

IDENTIFICADOR	SECCIÓN RELATIVA AL CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO UTILIZANDO EL MÉTODO ESTÁNDAR (CALIFICACIONES EXTERNAS)	LARGAS Y CORTAS EN EL MISMO TITULO		POSICIONES BRUTAS CORTAS
VII	TÍTULOS DE DEUDA CON CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS PONDERADOS AL 1250%	79225	<=	79125

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.

Tipo 1.- Mercado vs Crédito Contraparte

1.1 Reportos

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
1	TCT_1	ERROR ID. 1 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A REPORTOS TÍTULOS A RECIBIR (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
1	A	10600	30600	40600	110600	
1	A	10602	30602	40602	110602	
1	A	10604	30604	40604	110604	
1	A	10606	30606	40606	110606	
1	A	10608	30608	40608	110608	
1	A	10610	30610	40610	110610	
1	A	10612	30612	40612	110612	
1	A	10614	30614	40614	110614	
1	A	10616	30616	40616	110616	
1	A	10618	30618	40618	110618	
1	A	10620	30620	40620	110620	
1	A	10622	30622	40622	110622	
1	A	10624	30624	40624	110624	
1	A	10626	30626	40626	110626	
1	B					60310
1	B					60361
1	B					60410
1	B					60462
1	B					60510
1	B					60563

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
2	TCT_2	ERROR ID. 2 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A REPORTOS TÍTULOS A ENTREGAR (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
2	A	13700	33700	43700	113700	
2	A	13702	33702	43702	113702	
2	A	13704	33704	43704	113704	
2	A	13706	33706	43706	113706	
2	A	13708	33708	43708	113708	
2	A	13710	33710	43710	113710	
2	A	13712	33712	43712	113712	
2	A	13714	33714	43714	113714	
2	A	13716	33716	43716	113716	
2	A	13718	33718	43718	113718	
2	A	13720	33720	43720	113720	
2	A	13722	33722	43722	113722	
2	A	13724	33724	43724	113724	
2	A	13726	33726	43726	113726	
2	B					60020
2	B					60071
2	B					60120
2	B					60172
2	B					60220
2	B					60273

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	TCT_3	ERROR ID. 3 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A REPORTOS DINERO A RECIBIR (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06
3	A	10550	40550	
3	A	10552	40552	
3	A	10554	40554	
3	A	10556	40556	
3	A	10558	40558	
3	A	10560	40560	
3	A	10562	40562	
3	A	10564	40564	
3	A	10566	40566	
3	A	10568	40568	
3	A	10570	40570	
3	A	10572	40572	
3	A	10574	40574	
3	A	10576	40576	
3	B			60010
3	B			60061
3	B			60110
3	B			60162
3	B			60210
3	B			60263

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
4	TCT_4	ERROR ID. 4 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A REPORTOS DINERO A ENTREGAR (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06
4	A	13750	43750	
4	A	13752	43752	
4	A	13754	43754	
4	A	13756	43756	
4	A	13758	43758	
4	A	13760	43760	
4	A	13762	43762	
4	A	13764	43764	
4	A	13766	43766	
4	A	13768	43768	
4	A	13770	43770	
4	A	13772	43772	
4	A	13774	43774	
4	A	13776	43776	
4	B			60320
4	B			60371
4	B			60420
4	B			60472
4	B			60520
4	B			60573

1.2 Swaps

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
5	TCT_5	ERROR ID. 5 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A SWAPS (ACTIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
5	A	11050	31050	41110	111080	
5	A	11052	31052	41112	111082	
5	A	11054	31054	41114	111084	
5	A	11056	31056	41116	111086	
5	A	11058	31058	41118	111088	
5	A	11060	31060	41120	111090	
5	A	11062	31062	41122	111092	
5	A	11064	31064	41124	111094	
5	A	11066	31066	41126	111096	
5	A	11068	31068	41128	111098	
5	A	11070	31070	41130	111100	
5	A	11072	31072	41132	111102	
5	A	11074	31074	41134	111104	
5	A	11076	31076	41136	111106	
5	A	11080	31080	41140		
5	A	11082	31082	41142		
5	A	11084	31084	41144		
5	A	11086	31086	41146		
5	A	11088	31088	41148		
5	A	11090	31090	41150		
5	A	11092	31092	41152		
5	A	11094	31094	41154		
5	A	11096	31096	41156		
5	A	11098	31098	41158		
5	A	11100	31100	41160		
5	A	11102	31102	41162		
5	A	11104	31104	41164		
5	A	11106	31106	41166		
5	A	11110	31110	41170		
5	A	11112	31112	41172		
5	A	11114	31114	41174		
5	A	11116	31116	41176		
5	A	11118	31118	41178		
5	A	11120	31120	41180		
5	A	11122	31122	41182		
5	A	11124	31124	41184		
5	A	11126	31126	41186		
5	A	11128	31128	41188		
5	A	11130	31130	41190		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

5	A	11132	31132	41192		
5	A	11134	31134	41194		
5	A	11136	31136	41196		
5	B					60610
5	B					60661
5	B					60710
5	B					60762
5	B					60810
5	B					60863
5	B					65000
5	B					65015
5	B					65035
5	B					65050
5	B					65070
5	B					65085
5	B					65105
5	B					65120

6 TCT_6 ERROR ID. 6 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A SWAPS (PASIVOS BRUTOS) RC01,RC03,RC04,RC11 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
6	A	14200	34200	44260	114230	
6	A	14202	34202	44262	114232	
6	A	14204	34204	44264	114234	
6	A	14206	34206	44266	114236	
6	A	14208	34208	44268	114238	
6	A	14210	34210	44270	114240	
6	A	14212	34212	44272	114242	
6	A	14214	34214	44274	114244	
6	A	14216	34216	44276	114246	
6	A	14218	34218	44278	114248	
6	A	14220	34220	44280	114250	
6	A	14222	34222	44282	114252	
6	A	14224	34224	44284	114254	
6	A	14226	34226	44286	114256	
6	A	14230	34230	44290		
6	A	14232	34232	44292		
6	A	14234	34234	44294		
6	A	14236	34236	44296		
6	A	14238	34238	44298		
6	A	14240	34240	44300		
6	A	14242	34242	44302		
6	A	14244	34244	44304		
6	A	14246	34246	44306		
6	A	14248	34248	44308		
6	A	14250	34250	44310		
6	A	14252	34252	44312		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		6	A	14254	34254	44314		
		6	A	14256	34256	44316		
		6	A	14260	34260	44320		
		6	A	14262	34262	44322		
		6	A	14264	34264	44324		
		6	A	14266	34266	44326		
		6	A	14268	34268	44328		
		6	A	14270	34270	44330		
		6	A	14272	34272	44332		
		6	A	14274	34274	44334		
		6	A	14276	34276	44336		
		6	A	14278	34278	44338		
		6	A	14280	34280	44340		
		6	A	14282	34282	44342		
		6	A	14284	34284	44344		
		6	A	14286	34286	44346		
		6	B				60620	
		6	B				60671	
		6	B				60720	
		6	B				60772	
		6	B				60820	
		6	B				60873	
							65005	
							65020	
							65040	
							65055	
							65075	
							65090	
							65110	
							65125	

1.3 Forwards

1.3.1 Forwards de Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
7	TCT_7	ERROR ID. 7 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE DIVISAS (ACTIVA) RC04 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC06
7	A	40750	
7	A	40752	
7	A	40754	
7	A	40756	
7	A	40758	
7	A	40760	
7	A	40762	
7	A	40764	
7	A	40766	
7	A	40768	
7	A	40770	
7	A	40772	
7	A	40774	
7	A	40776	
7	B		61510
7	B		61561
7	B		61610
7	B		61662
7	B		61710
7	B		61763

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
8	TCT_8	ERROR ID. 8 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06
8	A	13900	43900	
8	A	13902	43902	
8	A	13904	43904	
8	A	13906	43906	
8	A	13908	43908	
8	A	13910	43910	
8	A	13912	43912	
8	A	13914	43914	
8	A	13916	43916	
8	A	13918	43918	
8	A	13920	43920	
8	A	13922	43922	
8	A	13924	43924	
8	A	13926	43926	
8	B			61520
8	B			61571
8	B			61620
8	B			61672
8	B			61720
8	B			61773

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
9	TCT_9	ERROR ID. 9 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE TASAS INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06
9	A	10630	30630	40630	
9	A	10632	30632	40632	
9	A	10634	30634	40634	
9	A	10636	30636	40636	
9	A	10638	30638	40638	
9	A	10640	30640	40640	
9	A	10642	30642	40642	
9	A	10644	30644	40644	
9	A	10646	30646	40646	
9	A	10648	30648	40648	
9	A	10650	30650	40650	
9	A	10652	30652	40652	
9	A	10654	30654	40654	
9	A	10656	30656	40656	
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	B				62110
9	B				62161
9	B				62210
9	B				62262
9	B				62310
9	B				62363

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
10	TCT_10	ERROR ID. 10 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE,RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06
10	A	13780	33780	43780	
10	A	13782	33782	43782	
10	A	13784	33784	43784	
10	A	13786	33786	43786	
10	A	13788	33788	43788	
10	A	13790	33790	43790	
10	A	13792	33792	43792	
10	A	13794	33794	43794	
10	A	13796	33796	43796	
10	A	13798	33798	43798	
10	A	13800	33800	43800	
10	A	13802	33802	43802	
10	A	13804	33804	43804	
10	A	13806	33806	43806	
10	A	14080	34080	44140	
10	A	14082	34082	44142	
10	A	14084	34084	44144	
10	A	14086	34086	44146	
10	A	14088	34088	44148	
10	A	14090	34090	44150	
10	A	14092	34092	44152	
10	A	14094	34094	44154	
10	A	14096	34096	44156	
10	A	14098	34098	44158	
10	A	14100	34100	44160	
10	A	14102	34102	44162	
10	A	14104	34104	44164	
10	A	14106	34106	44166	
10	B				62120
10	B				62171
10	B				62220
10	B				62272
10	B				62320
10	B				62373

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
11	TCT_11	ERROR ID. 11 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04, RC05,RC11 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05	RC06
11	A	10810	30810	40870	110630	50250	
11	A	10812	30812	40872	110632		
11	A	10814	30814	40874	110634		
11	A	10816	30816	40876	110636		
11	A	10818	30818	40878	110638		
11	A	10820	30820	40880	110640		
11	A	10822	30822	40882	110642		
11	A	10824	30824	40884	110644		
11	A	10826	30826	40886	110646		
11	A	10828	30828	40888	110648		
11	A	10830	30830	40890	110650		
11	A	10832	30832	40892	110652		
11	A	10834	30834	40894	110654		
11	A	10836	30836	40896	110656		
11	A	11870	31800	41930			
11	A	11872	31802	41932			
11	A	11874	31804	41934			
11	A	11876	31806	41936			
11	A	11878	31808	41938			
11	A	11880	31810	41940			
11	A	11882	31812	41942			
11	A	11884	31814	41944			
11	A	11886	31816	41946			
11	A	11888	31818	41948			
11	A	11890	31820	41950			
11	A	11892	31822	41952			
11	A	11894	31824	41954			
11	A	11896	31826	41956			
11	B						63310
11	B						63361
11	B						63410
11	B						63462
11	B						63510
11	B						63563

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
12	TCT_12	ERROR ID. 12 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS COMPRA DE OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
12	A	13960	33960	44020	113780	
12	A	13962	33962	44022	113782	
12	A	13964	33964	44024	113784	
12	A	13966	33966	44026	113786	
12	A	13968	33968	44028	113788	
12	A	13970	33970	44030	113790	
12	A	13972	33972	44032	113792	
12	A	13974	33974	44034	113794	
12	A	13976	33976	44036	113796	
12	A	13978	33978	44038	113798	
12	A	13980	33980	44040	113800	
12	A	13982	33982	44042	113802	
12	A	13984	33984	44044	113804	
12	A	13986	33986	44046	113806	
12	A	14970		45030		
12	A	14972		45032		
12	A	14974		45034		
12	A	14976		45036		
12	A	14978		45038		
12	A	14980		45040		
12	A	14982		45042		
12	A	14984		45044		
12	A	14986		45046		
12	A	14988		45048		
12	A	14990		45050		
12	A	14992		45052		
12	A	14994		45054		
12	A	14996		45056		
12	B					63320
12	B					63371
12	B					63420
12	B					63472
12	B					63520
12	B					63573

1.3.2 Forwards de Venta

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
13	TCT_13	ERROR ID. 13 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE DIVISAS (ACTIVA) RC01, RC04 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC06
13	A	10750	40780	
13	A	10752	40782	
13	A	10754	40784	
13	A	10756	40786	
13	A	10758	40788	
13	A	10760	40790	
13	A	10762	40792	
13	A	10764	40794	
13	A	10766	40796	
13	A	10768	40798	
13	A	10770	40800	
13	A	10772	40802	
13	A	10774	40804	
13	A	10776	40806	
13	B			61810
13	B			61861
13	B			61910
13	B			61962
13	B			62010
13	B			62063

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
14	TCT_14	ERROR ID. 14 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC06
14	A	43930	
14	A	43932	
14	A	43934	
14	A	43936	
14	A	43938	
14	A	43940	
14	A	43942	
14	A	43944	
14	A	43946	
14	A	43948	
14	A	43950	
14	A	43952	
14	A	43954	
14	A	43956	
14	B		61820
14	B		61871
14	B		61920
14	B		61972
14	B		62020
14	B		62073

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
15	TCT_15	ERROR ID. 15 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE TASAS INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06
15	A	10660	30660	40660	
15	A	10662	30662	40662	
15	A	10664	30664	40664	
15	A	10666	30666	40666	
15	A	10668	30668	40668	
15	A	10670	30670	40670	
15	A	10672	30672	40672	
15	A	10674	30674	40674	
15	A	10676	30676	40676	
15	A	10678	30678	40678	
15	A	10680	30680	40680	
15	A	10682	30682	40682	
15	A	10684	30684	40684	
15	A	10686	30686	40686	
15	A	10960	30960	41020	
15	A	10962	30962	41022	
15	A	10964	30964	41024	
15	A	10966	30966	41026	
15	A	10968	30968	41028	
15	A	10970	30970	41030	
15	A	10972	30972	41032	
15	A	10974	30974	41034	
15	A	10976	30976	41036	
15	A	10978	30978	41038	
15	A	10980	30980	41040	
15	A	10982	30982	41042	
15	A	10984	30984	41044	
15	A	10986	30986	41046	
15	B				62410
15	B				62461
15	B				62510
15	B				62562
15	B				62610
15	B				62663

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
16	TCT_16	ERROR ID. 16 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC06
16	A	13810	33810	43810	
16	A	13812	33812	43812	
16	A	13814	33814	43814	
16	A	13816	33816	43816	
16	A	13818	33818	43818	
16	A	13820	33820	43820	
16	A	13822	33822	43822	
16	A	13824	33824	43824	
16	A	13826	33826	43826	
16	A	13828	33828	43828	
16	A	13830	33830	43830	
16	A	13832	33832	43832	
16	A	13834	33834	43834	
16	A	13836	33836	43836	
16	A	14110	34110	44170	
16	A	14112	34112	44172	
16	A	14114	34114	44174	
16	A	14116	34116	44176	
16	A	14118	34118	44178	
16	A	14120	34120	44180	
16	A	14122	34122	44182	
16	A	14124	34124	44184	
16	A	14126	34126	44186	
16	A	14128	34128	44188	
16	A	14130	34130	44190	
16	A	14132	34132	44192	
16	A	14134	34134	44194	
16	A	14136	34136	44196	
16	B				62420
16	B				62471
16	B				62520
16	B				62572
16	B				62620
16	B				62673

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
17	TCT_17	ERROR ID. 17 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
17	A	10840	30840	40900	110660	
17	A	10842	30842	40902	110662	
17	A	10844	30844	40904	110664	
17	A	10846	30846	40906	110666	
17	A	10848	30848	40908	110668	
17	A	10850	30850	40910	110670	
17	A	10852	30852	40912	110672	
17	A	10854	30854	40914	110674	
17	A	10856	30856	40916	110676	
17	A	10858	30858	40918	110678	
17	A	10860	30860	40920	110680	
17	A	10862	30862	40922	110682	
17	A	10864	30864	40924	110684	
17	A	10866	30866	40926	110686	
17	A	11900		41960		
17	A	11902		41962		
17	A	11904		41964		
17	A	11906		41966		
17	A	11908		41968		
17	A	11910		41970		
17	A	11912		41972		
17	A	11914		41974		
17	A	11916		41976		
17	A	11918		41978		
17	A	11920		41980		
17	A	11922		41982		
17	A	11924		41984		
17	A	11926		41986		
17	B					63610
17	B					63661
17	B					63710
17	B					63762
17	B					63810
17	B					63863

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
18	TCT_18	ERROR ID. 18 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A FORWARDS VENTA DE OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05	RC06
18	A	13990	33990	44050	113810	51250	
18	A	13992	33992	44052	113812		
18	A	13994	33994	44054	113814		
18	A	13996	33996	44056	113816		
18	A	13998	33998	44058	113818		
18	A	14000	34000	44060	113820		
18	A	14002	34002	44062	113822		
18	A	14004	34004	44064	113824		
18	A	14006	34006	44066	113826		
18	A	14008	34008	44068	113828		
18	A	14010	34010	44070	113830		
18	A	14012	34012	44072	113832		
18	A	14014	34014	44074	113834		
18	A	14016	34016	44076	113836		
18	A	14998	34930	45060			
18	A	15000	34932	45062			
18	A	15002	34934	45064			
18	A	15004	34936	45066			
18	A	15006	34938	45068			
18	A	15008	34940	45070			
18	A	15010	34942	45072			
18	A	15012	34944	45074			
18	A	15014	34946	45076			
18	A	15016	34948	45078			
18	A	15018	34950	45080			
18	A	15020	34952	45082			
18	A	15022	34954	45084			
18	A	15024	34956	45086			
18	B						63620
18	B						63671
18	B						63720
18	B						63772
18	B						63820
18	B						63873

Contenido

1.4 Préstamos de Títulos de Deuda

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
19	TCT_19	ERROR ID. 19 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA ACTIVO RC01,RC03, RC04, RC11 VS ACTIVOS A RECIBIR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
19	A	10500	30500	40500	110500	
19	A	10502	30502	40502	110502	
19	A	10504	30504	40504	110504	
19	A	10506	30506	40506	110506	
19	A	10508	30508	40508	110508	
19	A	10510	30510	40510	110510	
19	A	10512	30512	40512	110512	
19	A	10514	30514	40514	110514	
19	A	10516	30516	40516	110516	
19	A	10518	30518	40518	110518	
19	A	10520	30520	40520	110520	
19	A	10522	30522	40522	110522	
19	A	10524	30524	40524	110524	
19	A	10526	30526	40526	110526	
19	B					63910
19	B					63961
19	B					64010
19	B					64062
19	B					64110
19	B					64163

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
20	TCT_20	ERROR ID. 20 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA PASIVO RC01,RC03, RC04, RC11 VS PASIVOS A ENTREGAR RC06	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC06
20	A	13650	33650	43650	113650	
20	A	13652	33652	43652	113652	
20	A	13654	33654	43654	113654	
20	A	13656	33656	43656	113656	
20	A	13658	33658	43658	113658	
20	A	13660	33660	43660	113660	
20	A	13662	33662	43662	113662	
20	A	13664	33664	43664	113664	
20	A	13666	33666	43666	113666	
20	A	13668	33668	43668	113668	
20	A	13670	33670	43670	113670	
20	A	13672	33672	43672	113672	
20	A	13674	33674	43674	113674	
20	A	13676	33676	43676	113676	
20	B					69300
20	B					69320
20	B					69350
20	B					69370
20	B					69400
20	B					69420

Tipo 2.- Mercado vs Crédito Emisor

2.1 Títulos de Deuda

2.1.1 Activos Brutos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
21	TCT_21	ERROR ID. 21 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (ACTIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN MN RC01 VS POSICIONES LARGAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC07
21	A	10300	
21	A	10302	
21	A	10304	
21	A	10306	
21	A	10308	
21	A	10310	
21	A	10312	
21	A	10314	
21	A	10316	
21	A	10318	
21	A	10320	
21	A	10322	
21	A	10324	
21	A	10326	
21	A	10350	
21	A	10352	
21	A	10354	
21	A	10356	
21	A	10358	
21	A	10360	
21	A	10362	
21	A	10364	
21	A	10366	
21	A	10368	
21	A	10370	
21	A	10372	
21	A	10374	
21	A	10376	
21	A	10400	
21	A	10402	
21	A	10404	
21	A	10406	
21	A	10408	
21	A	10410	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		21	A	10412		
		21	A	10414		
		21	A	10416		
		21	A	10418		
		21	A	10420		
		21	A	10422		
		21	A	10424		
		21	A	10426		
		21	A	10450		
		21	A	10452		
		21	A	10454		
		21	A	10456		
		21	A	10458		
		21	A	10460		
		21	A	10462		
		21	A	10464		
		21	A	10466		
		21	A	10468		
		21	A	10470		
		21	A	10472		
		21	A	10474		
		21	A	10476		
		21	A	10500		
		21	A	10502		
		21	A	10504		
		21	A	10506		
		21	A	10508		
		21	A	10510		
		21	A	10512		
		21	A	10514		
		21	A	10516		
		21	A	10518		
		21	A	10520		
		21	A	10522		
		21	A	10524		
		21	A	10526		
		21	A	10600		
		21	A	10602		
		21	A	10604		
		21	A	10606		
		21	A	10608		
		21	A	10610		
		21	A	10612		
		21	A	10614		
		21	A	10616		
		21	A	10618		
		21	A	10620		
		21	A	10622		
		21	A	10624		
		21	A	10626		
		21	B		70002	
		21	B		70005	
		21	B		70007	
		21	B		70010	
		21	B		70011	
		21	B		70022	
		21	B		70033	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
22	TCT_22	ERROR ID. 22 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (ACTIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN UDIS_SMG RC03, RC11VS POSICIONES LARGAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

***Dónde*:**

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC11	RC07
22	A	30300	110300	
22	A	30302	110302	
22	A	30304	110304	
22	A	30306	110306	
22	A	30308	110308	
22	A	30310	110310	
22	A	30312	110312	
22	A	30314	110314	
22	A	30316	110316	
22	A	30318	110318	
22	A	30320	110320	
22	A	30322	110322	
22	A	30324	110324	
22	A	30326	110326	
22	A	30350	110350	
22	A	30352	110352	
22	A	30354	110354	
22	A	30356	110356	
22	A	30358	110358	
22	A	30360	110360	
22	A	30362	110362	
22	A	30364	110364	
22	A	30366	110366	
22	A	30368	110368	
22	A	30370	110370	
22	A	30372	110372	
22	A	30374	110374	
22	A	30376	110376	
22	A	30400	110400	
22	A	30402	110402	
22	A	30404	110404	
22	A	30406	110406	
22	A	30408	110408	
22	A	30410	110410	
22	A	30412	110412	
22	A	30414	110414	
22	A	30416	110416	
22	A	30418	110418	
22	A	30420	110420	
22	A	30422	110422	
22	A	30424	110424	
22	A	30426	110426	
22	A	30450	110450	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		22	A	30452	110452		
		22	A	30454	110454		
		22	A	30456	110456		
		22	A	30458	110458		
		22	A	30460	110460		
		22	A	30462	110462		
		22	A	30464	110464		
		22	A	30466	110466		
		22	A	30468	110468		
		22	A	30470	110470		
		22	A	30472	110472		
		22	A	30474	110474		
		22	A	30476	110476		
		22	A	30500	110500		
		22	A	30502	110502		
		22	A	30504	110504		
		22	A	30506	110506		
		22	A	30508	110508		
		22	A	30510	110510		
		22	A	30512	110512		
		22	A	30514	110514		
		22	A	30516	110516		
		22	A	30518	110518		
		22	A	30520	110520		
		22	A	30522	110522		
		22	A	30524	110524		
		22	A	30526	110526		
		22	A	30600	110600		
		22	A	30602	110602		
		22	A	30604	110604		
		22	A	30606	110606		
		22	A	30608	110608		
		22	A	30610	110610		
		22	A	30612	110612		
		22	A	30614	110614		
		22	A	30616	110616		
		22	A	30618	110618		
		22	A	30620	110620		
		22	A	30622	110622		
		22	A	30624	110624		
		22	A	30626	110626		
		22	B			71002	
		22	B			71005	
		22	B			71007	
		22	B			71010	
		22	B			71011	
		22	B			71022	
		22	B			71033	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
23	TCT_23	ERROR ID. 23 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (ACTIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN ME RC04VS POSICIONES LARGAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC07
23	A	40300	
23	A	40302	
23	A	40304	
23	A	40306	
23	A	40308	
23	A	40310	
23	A	40312	
23	A	40314	
23	A	40316	
23	A	40318	
23	A	40320	
23	A	40322	
23	A	40324	
23	A	40326	
23	A	40350	
23	A	40352	
23	A	40354	
23	A	40356	
23	A	40358	
23	A	40360	
23	A	40362	
23	A	40364	
23	A	40366	
23	A	40368	
23	A	40370	
23	A	40372	
23	A	40374	
23	A	40376	
23	A	40400	
23	A	40402	
23	A	40404	
23	A	40406	
23	A	40408	
23	A	40410	
23	A	40412	
23	A	40414	
23	A	40416	
23	A	40418	
23	A	40420	
23	A	40422	
23	A	40424	
23	A	40426	
23	A	40450	
23	A	40452	
23	A	40454	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		23	A	40456		
		23	A	40458		
		23	A	40460		
		23	A	40462		
		23	A	40464		
		23	A	40466		
		23	A	40468		
		23	A	40470		
		23	A	40472		
		23	A	40474		
		23	A	40476		
		23	A	40500		
		23	A	40502		
		23	A	40504		
		23	A	40506		
		23	A	40508		
		23	A	40510		
		23	A	40512		
		23	A	40514		
		23	A	40516		
		23	A	40518		
		23	A	40520		
		23	A	40522		
		23	A	40524		
		23	A	40526		
		23	A	40600		
		23	A	40602		
		23	A	40604		
		23	A	40606		
		23	A	40608		
		23	A	40610		
		23	A	40612		
		23	A	40614		
		23	A	40616		
		23	A	40618		
		23	A	40620		
		23	A	40622		
		23	A	40624		
		23	A	40626		
		23	B		73002	
		23	B		73005	
		23	B		73007	
		23	B		73010	
		23	B		73011	
		23	B		73022	
		23	B		73033	
		23	B		73091	
		23	B		73092	
		23	B		73093	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
56	TCT_56	ERROR ID. 56 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (ACTIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN MN, ME, UDIS, SMG, Y QUE NO REVELAN RGO RC01,RC03,RC04,RC11 VS POSICIONES LARGAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC07
56	A	10300	30300	40300	110300	
56	A	10302	30302	40302	110302	
56	A	10304	30304	40304	110304	
56	A	10306	30306	40306	110306	
56	A	10308	30308	40308	110308	
56	A	10310	30310	40310	110310	
56	A	10312	30312	40312	110312	
56	A	10314	30314	40314	110314	
56	A	10316	30316	40316	110316	
56	A	10318	30318	40318	110318	
56	A	10320	30320	40320	110320	
56	A	10322	30322	40322	110322	
56	A	10324	30324	40324	110324	
56	A	10326	30326	40326	110326	
56	A	10350	30350	40350	110350	
56	A	10352	30352	40352	110352	
56	A	10354	30354	40354	110354	
56	A	10356	30356	40356	110356	
56	A	10358	30358	40358	110358	
56	A	10360	30360	40360	110360	
56	A	10362	30362	40362	110362	
56	A	10364	30364	40364	110364	
56	A	10366	30366	40366	110366	
56	A	10368	30368	40368	110368	
56	A	10370	30370	40370	110370	
56	A	10372	30372	40372	110372	
56	A	10374	30374	40374	110374	
56	A	10376	30376	40376	110376	
56	A	10400	30400	40400	110400	
56	A	10402	30402	40402	110402	
56	A	10404	30404	40404	110404	
56	A	10406	30406	40406	110406	
56	A	10408	30408	40408	110408	
56	A	10410	30410	40410	110410	
56	A	10412	30412	40412	110412	
56	A	10414	30414	40414	110414	
56	A	10416	30416	40416	110416	
56	A	10418	30418	40418	110418	
56	A	10420	30420	40420	110420	
56	A	10422	30422	40422	110422	
56	A	10424	30424	40424	110424	
56	A	10426	30426	40426	110426	
56	A	10450	30450	40450	110450	
56	A	10452	30452	40452	110452	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		56	A	10454	30454	40454	110454		
		56	A	10456	30456	40456	110456		
		56	A	10458	30458	40458	110458		
		56	A	10460	30460	40460	110460		
		56	A	10462	30462	40462	110462		
		56	A	10464	30464	40464	110464		
		56	A	10466	30466	40466	110466		
		56	A	10468	30468	40468	110468		
		56	A	10470	30470	40470	110470		
		56	A	10472	30472	40472	110472		
		56	A	10474	30474	40474	110474		
		56	A	10476	30476	40476	110476		
		56	A	10500	30500	40500	110500		
		56	A	10502	30502	40502	110502		
		56	A	10504	30504	40504	110504		
		56	A	10506	30506	40506	110506		
		56	A	10508	30508	40508	110508		
		56	A	10510	30510	40510	110510		
		56	A	10512	30512	40512	110512		
		56	A	10514	30514	40514	110514		
		56	A	10516	30516	40516	110516		
		56	A	10518	30518	40518	110518		
		56	A	10520	30520	40520	110520		
		56	A	10522	30522	40522	110522		
		56	A	10524	30524	40524	110524		
		56	A	10526	30526	40526	110526		
		56	A	10600	30600	40600	110600		
		56	A	10602	30602	40602	110602		
		56	A	10604	30604	40604	110604		
		56	A	10606	30606	40606	110606		
		56	A	10608	30608	40608	110608		
		56	A	10610	30610	40610	110610		
		56	A	10612	30612	40612	110612		
		56	A	10614	30614	40614	110614		
		56	A	10616	30616	40616	110616		
		56	A	10618	30618	40618	110618		
		56	A	10620	30620	40620	110620		
		56	A	10622	30622	40622	110622		
		56	A	10624	30624	40624	110624		
		56	A	10626	30626	40626	110626		
		56	B					70002	
		56	B					70005	
		56	B					70007	
		56	B					70010	
		56	B					70011	
		56	B					70022	
		56	B					70033	
		56	B					71002	
		56	B					71005	
		56	B					71007	
		56	B					71010	
		56	B					71011	
		56	B					71022	
		56	B					71033	
		56	B					73002	
		56	B					73005	
		56	B					73007	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo						Nivel
		56	B					73010	
		56	B					73011	
		56	B					73022	
		56	B					73033	
		56	B					73091	
		56	B					73092	
		56	B					73093	
		56	B					76005	

2.1.2 Pasivos Brutos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
24	TCT_24	ERROR ID. 24 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (PASIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN MN RC01 VS POSICIONES CORTAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC07
24	A	13500	
24	A	13502	
24	A	13504	
24	A	13506	
24	A	13508	
24	A	13510	
24	A	13512	
24	A	13514	
24	A	13516	
24	A	13518	
24	A	13520	
24	A	13522	
24	A	13524	
24	A	13526	
24	A	13550	
24	A	13552	
24	A	13554	
24	A	13556	
24	A	13558	
24	A	13560	
24	A	13562	
24	A	13564	
24	A	13566	
24	A	13568	
24	A	13570	
24	A	13572	
24	A	13574	
24	A	13576	
24	A	13600	
24	A	13602	
24	A	13604	
24	A	13606	
24	A	13608	
24	A	13610	
24	A	13612	
24	A	13614	
24	A	13616	
24	A	13618	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		24	A	13620		
		24	A	13622		
		24	A	13624		
		24	A	13626		
		24	A	13650		
		24	A	13652		
		24	A	13654		
		24	A	13656		
		24	A	13658		
		24	A	13660		
		24	A	13662		
		24	A	13664		
		24	A	13666		
		24	A	13668		
		24	A	13670		
		24	A	13672		
		24	A	13674		
		24	A	13676		
		24	A	13700		
		24	A	13702		
		24	A	13704		
		24	A	13706		
		24	A	13708		
		24	A	13710		
		24	A	13712		
		24	A	13714		
		24	A	13716		
		24	A	13718		
		24	A	13720		
		24	A	13722		
		24	A	13724		
		24	A	13726		
		24	B		70102	
		24	B		70105	
		24	B		70107	
		24	B		70110	
		24	B		70111	
		24	B		70122	
		24	B		70133	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
25	TCT_25	ERROR ID. 25 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (PASIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN UDIS_SMG RC03,RC11 VS POSICIONES CORTAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC03	RC11	RC07
25	A	33500	113500	
25	A	33502	113502	
25	A	33504	113504	
25	A	33506	113506	
25	A	33508	113508	
25	A	33510	113510	
25	A	33512	113512	
25	A	33514	113514	
25	A	33516	113516	
25	A	33518	113518	
25	A	33520	113520	
25	A	33522	113522	
25	A	33524	113524	
25	A	33526	113526	
25	A	33550	113550	
25	A	33552	113552	
25	A	33554	113554	
25	A	33556	113556	
25	A	33558	113558	
25	A	33560	113560	
25	A	33562	113562	
25	A	33564	113564	
25	A	33566	113566	
25	A	33568	113568	
25	A	33570	113570	
25	A	33572	113572	
25	A	33574	113574	
25	A	33576	113576	
25	A	33600	113600	
25	A	33602	113602	
25	A	33604	113604	
25	A	33606	113606	
25	A	33608	113608	
25	A	33610	113610	
25	A	33612	113612	
25	A	33614	113614	
25	A	33616	113616	
25	A	33618	113618	
25	A	33620	113620	
25	A	33622	113622	
25	A	33624	113624	
25	A	33626	113626	
25	A	33650	113650	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo					Nivel
		25	A	33652	113652		
		25	A	33654	113654		
		25	A	33656	113656		
		25	A	33658	113658		
		25	A	33660	113660		
		25	A	33662	113662		
		25	A	33664	113664		
		25	A	33666	113666		
		25	A	33668	113668		
		25	A	33670	113670		
		25	A	33672	113672		
		25	A	33674	113674		
		25	A	33676	113676		
		25	A	33700	113700		
		25	A	33702	113702		
		25	A	33704	113704		
		25	A	33706	113706		
		25	A	33708	113708		
		25	A	33710	113710		
		25	A	33712	113712		
		25	A	33714	113714		
		25	A	33716	113716		
		25	A	33718	113718		
		25	A	33720	113720		
		25	A	33722	113722		
		25	A	33724	113724		
		25	A	33726	113726		
		25	B			71102	
		25	B			71105	
		25	B			71107	
		25	B			71110	
		25	B			71111	
		25	B			71122	
		25	B			71133	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
26	TCT_26	ERROR ID. 26 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (PASIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN ME RC04 VS POSICIONES CORTAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC04	RC07
26	A	43500	
26	A	43502	
26	A	43504	
26	A	43506	
26	A	43508	
26	A	43510	
26	A	43512	
26	A	43514	
26	A	43516	
26	A	43518	
26	A	43520	
26	A	43522	
26	A	43524	
26	A	43526	
26	A	43550	
26	A	43552	
26	A	43554	
26	A	43556	
26	A	43558	
26	A	43560	
26	A	43562	
26	A	43564	
26	A	43566	
26	A	43568	
26	A	43570	
26	A	43572	
26	A	43574	
26	A	43576	
26	A	43600	
26	A	43602	
26	A	43604	
26	A	43606	
26	A	43608	
26	A	43610	
26	A	43612	
26	A	43614	
26	A	43616	
26	A	43618	
26	A	43620	
26	A	43622	
26	A	43624	
26	A	43626	
26	A	43650	
26	A	43652	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo				Nivel
		26	A	43654		
		26	A	43656		
		26	A	43658		
		26	A	43660		
		26	A	43662		
		26	A	43664		
		26	A	43666		
		26	A	43668		
		26	A	43670		
		26	A	43672		
		26	A	43674		
		26	A	43676		
		26	A	43700		
		26	A	43702		
		26	A	43704		
		26	A	43706		
		26	A	43708		
		26	A	43710		
		26	A	43712		
		26	A	43714		
		26	A	43716		
		26	A	43718		
		26	A	43720		
		26	A	43722		
		26	A	43724		
		26	A	43726		
		26	B		73102	
		26	B		73105	
		26	B		73107	
		26	B		73110	
		26	B		73111	
		26	B		73122	
		26	B		73133	
		26	B		73191	
		26	B		73192	
		26	B		73193	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
57	TCT_57	ERROR ID. 57 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A (PASIVOS BRUTOS) TÍTULOS DE DEUDA VARIAS OPERACIONES EN MN, ME, UDIS, SMG, NO REVELAN RGO RC01,RC03,RC04,RC11 VS POSICIONES CORTAS RC07	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC07
57	A	13500	33500	43500	113500	
57	A	13502	33502	43502	113502	
57	A	13504	33504	43504	113504	
57	A	13506	33506	43506	113506	
57	A	13508	33508	43508	113508	
57	A	13510	33510	43510	113510	
57	A	13512	33512	43512	113512	
57	A	13514	33514	43514	113514	
57	A	13516	33516	43516	113516	
57	A	13518	33518	43518	113518	
57	A	13520	33520	43520	113520	
57	A	13522	33522	43522	113522	
57	A	13524	33524	43524	113524	
57	A	13526	33526	43526	113526	
57	A	13550	33550	43550	113550	
57	A	13552	33552	43552	113552	
57	A	13554	33554	43554	113554	
57	A	13556	33556	43556	113556	
57	A	13558	33558	43558	113558	
57	A	13560	33560	43560	113560	
57	A	13562	33562	43562	113562	
57	A	13564	33564	43564	113564	
57	A	13566	33566	43566	113566	
57	A	13568	33568	43568	113568	
57	A	13570	33570	43570	113570	
57	A	13572	33572	43572	113572	
57	A	13574	33574	43574	113574	
57	A	13576	33576	43576	113576	
57	A	13600	33600	43600	113600	
57	A	13602	33602	43602	113602	
57	A	13604	33604	43604	113604	
57	A	13606	33606	43606	113606	
57	A	13608	33608	43608	113608	
57	A	13610	33610	43610	113610	
57	A	13612	33612	43612	113612	
57	A	13614	33614	43614	113614	
57	A	13616	33616	43616	113616	
57	A	13618	33618	43618	113618	
57	A	13620	33620	43620	113620	
57	A	13622	33622	43622	113622	
57	A	13624	33624	43624	113624	
57	A	13626	33626	43626	113626	
57	A	13650	33650	43650	113650	
57	A	13652	33652	43652	113652	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		57	A	13654	33654	43654	113654		
		57	A	13656	33656	43656	113656		
		57	A	13658	33658	43658	113658		
		57	A	13660	33660	43660	113660		
		57	A	13662	33662	43662	113662		
		57	A	13664	33664	43664	113664		
		57	A	13666	33666	43666	113666		
		57	A	13668	33668	43668	113668		
		57	A	13670	33670	43670	113670		
		57	A	13672	33672	43672	113672		
		57	A	13674	33674	43674	113674		
		57	A	13676	33676	43676	113676		
		57	A	13700	33700	43700	113700		
		57	A	13702	33702	43702	113702		
		57	A	13704	33704	43704	113704		
		57	A	13706	33706	43706	113706		
		57	A	13708	33708	43708	113708		
		57	A	13710	33710	43710	113710		
		57	A	13712	33712	43712	113712		
		57	A	13714	33714	43714	113714		
		57	A	13716	33716	43716	113716		
		57	A	13718	33718	43718	113718		
		57	A	13720	33720	43720	113720		
		57	A	13722	33722	43722	113722		
		57	A	13724	33724	43724	113724		
		57	A	13726	33726	43726	113726		
		57	B					70102	
		57	B					70105	
		57	B					70107	
		57	B					70110	
		57	B					70111	
		57	B					70122	
		57	B					70133	
		57	B					71102	
		57	B					71105	
		57	B					71107	
		57	B					71110	
		57	B					71111	
		57	B					71122	
		57	B					71133	
		57	B					73102	
		57	B					73105	
		57	B					73107	
		57	B					73110	
		57	B					73111	
		57	B					73122	
		57	B					73133	
		57	B					73191	
		57	B					73192	
		57	B					73193	
		57	B					76125	

Tipo 3.- Mercado (ACTIVO) vs Crédito Créditos

3.1 Depósitos a la Vista y a Plazo

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
27	TCT_27	ERROR ID. 27 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO (ACTIVOS BRUTOS), RELATIVO A DEPÓSITOS A LA VISTA Y A PLAZO RC01,RC03,RC04,RC11 VS RC08 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** *Dónde:*	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC08
27	A	10050	30100	40050	
27	A	10100	30102	40100	
27	A	10102	30104	40102	
27	A	10104	30106	40104	
27	A	10106	30108	40106	
27	A	10108	30110	40108	
27	A	10110	30112	40110	
27	A	10112	30114	40112	
27	A	10114	30116	40114	
27	A	10116	30118	40116	
27	A	10118	30120	40118	
27	A	10120	30122	40120	
27	A	10122	30124	40122	
27	A	10124	30126	40124	
27	A	10126		40126	
27	B				80301
27	B				80303
27	B				80403
27	B				80651
27	B				81672
27	B				81722
27	B				81813
27	B				81912
27	B				81945
27	B				82112
27	B				82115
27	B				82412

3.2 Acciones

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
59	TCT_59	ERROR ID. 59 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO (ACTIVOS BRUTOS), RELATIVO A INVERSIONES PERMANENTES EN ACCIONES DE EMPRESAS COTIZADAS RC05 (50110) VS RC08 (89803) ***Algoritmo*:** **A – B =0** **Con tolerancia de 0%** ***Dónde:*** **ID VALIDACIÓN** / **ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN** / **RC05** / **RC08** 59 / A / 50110 / 59 / B / / 89803	Grave

Tipo 4.- Mercado (ACTIVO) vs Mercado (PASIVO)

4.1 Swaps

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
28	TCT_28	ERROR ID. 28 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A SWAPS ACTIVA RC01,RC03,RC04,RC05,RC11 VS PASIVA RC01,RC03,RC04,RC05, RC11	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05
28	A	11050	31050	41110	111080	50400
28	A	11052	31052	41112	111082	
28	A	11054	31054	41114	111084	
28	A	11056	31056	41116	111086	
28	A	11058	31058	41118	111088	
28	A	11060	31060	41120	111090	
28	A	11062	31062	41122	111092	
28	A	11064	31064	41124	111094	
28	A	11066	31066	41126	111096	
28	A	11068	31068	41128	111098	
28	A	11070	31070	41130	111100	
28	A	11072	31072	41132	111102	
28	A	11074	31074	41134	111104	
28	A	11076	31076	41136	111106	
28	A	11080	31080	41140		
28	A	11082	31082	41142		
28	A	11084	31084	41144		
28	A	11086	31086	41146		
28	A	11088	31088	41148		
28	A	11090	31090	41150		
28	A	11092	31092	41152		
28	A	11094	31094	41154		
28	A	11096	31096	41156		
28	A	11098	31098	41158		
28	A	11100	31100	41160		
28	A	11102	31102	41162		
28	A	11104	31104	41164		
28	A	11106	31106	41166		
28	A	11110	31110	41170		
28	A	11112	31112	41172		
28	A	11114	31114	41174		
28	A	11116	31116	41176		
28	A	11118	31118	41178		
28	A	11120	31120	41180		
28	A	11122	31122	41182		
28	A	11124	31124	41184		

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		28	A	11126	31126	41186			
		28	A	11128	31128	41188			
		28	A	11130	31130	41190			
		28	A	11132	31132	41192			
		28	A	11134	31134	41194			
		28	A	11136	31136	41196			
		28	B	14200	34200	44260	114230	51400	
		28	B	14202	34202	44262	114232		
		28	B	14204	34204	44264	114234		
		28	B	14206	34206	44266	114236		
		28	B	14208	34208	44268	114238		
		28	B	14210	34210	44270	114240		
		28	B	14212	34212	44272	114242		
		28	B	14214	34214	44274	114244		
		28	B	14216	34216	44276	114246		
		28	B	14218	34218	44278	114248		
		28	B	14220	34220	44280	114250		
		28	B	14222	34222	44282	114252		
		28	B	14224	34224	44284	114254		
		28	B	14226	34226	44286	114256		
		28	B	14230	34230	44290			
		28	B	14232	34232	44292			
		28	B	14234	34234	44294			
		28	B	14236	34236	44296			
		28	B	14238	34238	44298			
		28	B	14240	34240	44300			
		28	B	14242	34242	44302			
		28	B	14244	34244	44304			
		28	B	14246	34246	44306			
		28	B	14248	34248	44308			
		28	B	14250	34250	44310			
		28	B	14252	34252	44312			
		28	B	14254	34254	44314			
		28	B	14256	34256	44316			
		28	B	14260	34260	44320			
		28	B	14262	34262	44322			
		28	B	14264	34264	44324			
		28	B	14266	34266	44326			
		28	B	14268	34268	44328			
		28	B	14270	34270	44330			
		28	B	14272	34272	44332			
		28	B	14274	34274	44334			
		28	B	14276	34276	44336			
		28	B	14278	34278	44338			
		28	B	14280	34280	44340			
		28	B	14282	34282	44342			
		28	B	14284	34284	44344			
		28	B	14286	34286	44346			

4.2 Futuros

4.2.1 Futuros de Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
29	TCT_29	ERROR ID. 29 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS COMPRA DIVISAS (ACTIVA) RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04 ***Algoritmo*:** **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
29	A			40810
29	A			40812
29	A			40814
29	A			40816
29	A			40818
29	A			40820
29	A			40822
29	A			40824
29	A			40826
29	A			40828
29	A			40830
29	A			40832
29	A			40834
29	A			40836
29	B	13930		43960
29	B	13932		43962
29	B	13934		43964
29	B	13936		43966
29	B	13938		43968
29	B	13940		43970
29	B	13942		43972
29	B	13944		43974
29	B	13946		43976
29	B	13948		43978
29	B	13950		43980
29	B	13952		43982
29	B	13954		43984
29	B	13956		43986

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
30	TCT_30	ERROR ID. 30 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
30	A	10690	30690	40690
30	A	10692	30692	40692
30	A	10694	30694	40694
30	A	10696	30696	40696
30	A	10698	30698	40698
30	A	10700	30700	40700
30	A	10702	30702	40702
30	A	10704	30704	40704
30	A	10706	30706	40706
30	A	10708	30708	40708
30	A	10710	30710	40710
30	A	10712	30712	40712
30	A	10714	30714	40714
30	A	10716	30716	40716
30	A	10990	30990	41050
30	A	10992	30992	41052
30	A	10994	30994	41054
30	A	10996	30996	41056
30	A	10998	30998	41058
30	A	11000	31000	41060
30	A	11002	31002	41062
30	A	11004	31004	41064
30	A	11006	31006	41066
30	A	11008	31008	41068
30	A	11010	31010	41070
30	A	11012	31012	41072
30	A	11014	31014	41074
30	A	11016	31016	41076
30	B	13840	33840	43840
30	B	13842	33842	43842
30	B	13844	33844	43844
30	B	13846	33846	43846
30	B	13848	33848	43848
30	B	13850	33850	43850
30	B	13852	33852	43852
30	B	13854	33854	43854
30	B	13856	33856	43856
30	B	13858	33858	43858
30	B	13860	33860	43860
30	B	13862	33862	43862
30	B	13864	33864	43864
30	B	13866	33866	43866
30	B	14140	34140	44200
30	B	14142	34142	44202

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		30	B	14144	34144	44204
		30	B	14146	34146	44206
		30	B	14148	34148	44208
		30	B	14150	34150	44210
		30	B	14152	34152	44212
		30	B	14154	34154	44214
		30	B	14156	34156	44216
		30	B	14158	34158	44218
		30	B	14160	34160	44220
		30	B	14162	34162	44222
		30	B	14164	34164	44224
		30	B	14166	34166	44226

31 TCT_31 ERROR ID. 31 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC05
31	A	10870	30870	40930	50255
31	A	10872	30872	40932	
31	A	10874	30874	40934	
31	A	10876	30876	40936	
31	A	10878	30878	40938	
31	A	10880	30880	40940	
31	A	10882	30882	40942	
31	A	10884	30884	40944	
31	A	10886	30886	40946	
31	A	10888	30888	40948	
31	A	10890	30890	40950	
31	A	10892	30892	40952	
31	A	10894	30894	40954	
31	A	10896	30896	40956	
31	B	14020	34020	44080	
31	B	14022	34022	44082	
31	B	14024	34024	44084	
31	B	14026	34026	44086	
31	B	14028	34028	44088	
31	B	14030	34030	44090	
31	B	14032	34032	44092	
31	B	14034	34034	44094	
31	B	14036	34036	44096	
31	B	14038	34038	44098	
31	B	14040	34040	44100	
31	B	14042	34042	44102	
31	B	14044	34044	44104	
31	B	14046	34046	44106	

4.2.2 Futuros de Venta

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>32</td><td>TCT_32</td><td>ERROR ID. 32 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS VENTA DIVISAS (ACTIVA) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC04
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></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10780</td><td>40840</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10782</td><td>40842</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10784</td><td>40844</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10786</td><td>40846</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10788</td><td>40848</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10790</td><td>40850</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10792</td><td>40852</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10794</td><td>40854</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10796</td><td>40856</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10798</td><td>40858</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10800</td><td>40860</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10802</td><td>40862</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10804</td><td>40864</td></tr>
<tr><td>32</td><td>A</td><td>10806</td><td>40866</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>43990</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>43992</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>43994</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>43996</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>43998</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44000</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44002</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44004</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44006</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44008</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44010</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44012</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44014</td></tr>
<tr><td>32</td><td>B</td><td></td><td>44016</td></tr>
</table>
</td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
33	TCT_33	ERROR ID. 33 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS VENTA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
33	A	10720	30720	40720
33	A	10722	30722	40722
33	A	10724	30724	40724
33	A	10726	30726	40726
33	A	10728	30728	40728
33	A	10730	30730	40730
33	A	10732	30732	40732
33	A	10734	30734	40734
33	A	10736	30736	40736
33	A	10738	30738	40738
33	A	10740	30740	40740
33	A	10742	30742	40742
33	A	10744	30744	40744
33	A	10746	30746	40746
33	A	11020	31020	41080
33	A	11022	31022	41082
33	A	11024	31024	41084
33	A	11026	31026	41086
33	A	11028	31028	41088
33	A	11030	31030	41090
33	A	11032	31032	41092
33	A	11034	31034	41094
33	A	11036	31036	41096
33	A	11038	31038	41098
33	A	11040	31040	41100
33	A	11042	31042	41102
33	A	11044	31044	41104
33	A	11046	31046	41106
33	B	13870	33870	43870
33	B	13872	33872	43872
33	B	13874	33874	43874
33	B	13876	33876	43876
33	B	13878	33878	43878
33	B	13880	33880	43880
33	B	13882	33882	43882
33	B	13884	33884	43884
33	B	13886	33886	43886
33	B	13888	33888	43888
33	B	13890	33890	43890
33	B	13892	33892	43892
33	B	13894	33894	43894
33	B	13896	33896	43896
33	B	14170	34170	44230

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		33	B	14172	34172	44232
		33	B	14174	34174	44234
		33	B	14176	34176	44236
		33	B	14178	34178	44238
		33	B	14180	34180	44240
		33	B	14182	34182	44242
		33	B	14184	34184	44244
		33	B	14186	34186	44246
		33	B	14188	34188	44248
		33	B	14190	34190	44250
		33	B	14192	34192	44252
		33	B	14194	34194	44254
		33	B	14196	34196	44256

34 TCT_34 ERROR ID. 34 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FUTUROS VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC05
34	A	10900	30900	40960	
34	A	10902	30902	40962	
34	A	10904	30904	40964	
34	A	10906	30906	40966	
34	A	10908	30908	40968	
34	A	10910	30910	40970	
34	A	10912	30912	40972	
34	A	10914	30914	40974	
34	A	10916	30916	40976	
34	A	10918	30918	40978	
34	A	10920	30920	40980	
34	A	10922	30922	40982	
34	A	10924	30924	40984	
34	A	10926	30926	40986	
34	B	14050	34050	44110	51255
34	B	14052	34052	44112	
34	B	14054	34054	44114	
34	B	14056	34056	44116	
34	B	14058	34058	44118	
34	B	14060	34060	44120	
34	B	14062	34062	44122	
34	B	14064	34064	44124	
34	B	14066	34066	44126	
34	B	14068	34068	44128	
34	B	14070	34070	44130	
34	B	14072	34072	44132	
34	B	14074	34074	44134	
34	B	14076	34076	44136	

4.3 Forwards

4.3.1 Forwards de Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
35	TCT_35	ERROR ID. 35 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS COMPRA DIVISAS (ACTIVA) RC01 RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
35	A		40750
35	A		40752
35	A		40754
35	A		40756
35	A		40758
35	A		40760
35	A		40762
35	A		40764
35	A		40766
35	A		40768
35	A		40770
35	A		40772
35	A		40774
35	A		40776
35	B	13900	43900
35	B	13902	43902
35	B	13904	43904
35	B	13906	43906
35	B	13908	43908
35	B	13910	43910
35	B	13912	43912
35	B	13914	43914
35	B	13916	43916
35	B	13918	43918
35	B	13920	43920
35	B	13922	43922
35	B	13924	43924
35	B	13926	43926

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
36	TCT_36	ERROR ID. 36 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
36	A	10630	30630	40630
36	A	10632	30632	40632
36	A	10634	30634	40634
36	A	10636	30636	40636
36	A	10638	30638	40638
36	A	10640	30640	40640
36	A	10642	30642	40642
36	A	10644	30644	40644
36	A	10646	30646	40646
36	A	10648	30648	40648
36	A	10650	30650	40650
36	A	10652	30652	40652
36	A	10654	30654	40654
36	A	10656	30656	40656
36	A	10930	30930	40990
36	A	10932	30932	40992
36	A	10934	30934	40994
36	A	10936	30936	40996
36	A	10938	30938	40998
36	A	10940	30940	41000
36	A	10942	30942	41002
36	A	10944	30944	41004
36	A	10946	30946	41006
36	A	10948	30948	41008
36	A	10950	30950	41010
36	A	10952	30952	41012
36	A	10954	30954	41014
36	A	10956	30956	41016
36	B	13780	33780	43780
36	B	13782	33782	43782
36	B	13784	33784	43784
36	B	13786	33786	43786
36	B	13788	33788	43788
36	B	13790	33790	43790
36	B	13792	33792	43792
36	B	13794	33794	43794
36	B	13796	33796	43796
36	B	13798	33798	43798
36	B	13800	33800	43800
36	B	13802	33802	43802
36	B	13804	33804	43804
36	B	13806	33806	43806
36	B	14080	34080	44140
36	B	14082	34082	44142

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		36	B	14084	34084	44144	
		36	B	14086	34086	44146	
		36	B	14088	34088	44148	
		36	B	14090	34090	44150	
		36	B	14092	34092	44152	
		36	B	14094	34094	44154	
		36	B	14096	34096	44156	
		36	B	14098	34098	44158	
		36	B	14100	34100	44160	
		36	B	14102	34102	44162	
		36	B	14104	34104	44164	
		36	B	14106	34106	44166	
37	TCT_37	ERROR ID. 37 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04,RC05, RC11VSOTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC05	RC11
37	A	10810	30810	40870	50250	110630
37	A	10812	30812	40872		110632
37	A	10814	30814	40874		110634
37	A	10816	30816	40876		110636
37	A	10818	30818	40878		110638
37	A	10820	30820	40880		110640
37	A	10822	30822	40882		110642
37	A	10824	30824	40884		110644
37	A	10826	30826	40886		110646
37	A	10828	30828	40888		110648
37	A	10830	30830	40890		110650
37	A	10832	30832	40892		110652
37	A	10834	30834	40894		110654
37	A	10836	30836	40896		110656
37	B	13960	33960	44020		113780
37	B	13962	33962	44022		113782
37	B	13964	33964	44024		113784
37	B	13966	33966	44026		113786
37	B	13968	33968	44028		113788
37	B	13970	33970	44030		113790
37	B	13972	33972	44032		113792
37	B	13974	33974	44034		113794
37	B	13976	33976	44036		113796
37	B	13978	33978	44038		113798
37	B	13980	33980	44040		113800
37	B	13982	33982	44042		113802
37	B	13984	33984	44044		113804
37	B	13986	33986	44046		113806

4.3.2 Forwards de Venta

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>38</td><td>TCT_38</td><td>ERROR ID. 38 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS VENTA DIVISAS (ACTIVA) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC04
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></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10750</td><td>40780</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10752</td><td>40782</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10754</td><td>40784</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10756</td><td>40786</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10758</td><td>40788</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10760</td><td>40790</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10762</td><td>40792</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10764</td><td>40794</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10766</td><td>40796</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10768</td><td>40798</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10770</td><td>40800</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10772</td><td>40802</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10774</td><td>40804</td></tr>
<tr><td>38</td><td>A</td><td>10776</td><td>40806</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43930</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43932</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43934</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43936</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43938</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43940</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43942</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43944</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43946</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43948</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43950</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43952</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43954</td></tr>
<tr><td>38</td><td>B</td><td></td><td>43956</td></tr>
</table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
39	TCT_39	ERROR ID. 39 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS VENTA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
39	A	10660	30660	40660
39	A	10662	30662	40662
39	A	10664	30664	40664
39	A	10666	30666	40666
39	A	10668	30668	40668
39	A	10670	30670	40670
39	A	10672	30672	40672
39	A	10674	30674	40674
39	A	10676	30676	40676
39	A	10678	30678	40678
39	A	10680	30680	40680
39	A	10682	30682	40682
39	A	10684	30684	40684
39	A	10686	30686	40686
39	A	10960	30960	41020
39	A	10962	30962	41022
39	A	10964	30964	41024
39	A	10966	30966	41026
39	A	10968	30968	41028
39	A	10970	30970	41030
39	A	10972	30972	41032
39	A	10974	30974	41034
39	A	10976	30976	41036
39	A	10978	30978	41038
39	A	10980	30980	41040
39	A	10982	30982	41042
39	A	10984	30984	41044
39	A	10986	30986	41046
39	B	13810	33810	43810
39	B	13812	33812	43812
39	B	13814	33814	43814
39	B	13816	33816	43816
39	B	13818	33818	43818
39	B	13820	33820	43820
39	B	13822	33822	43822
39	B	13824	33824	43824
39	B	13826	33826	43826
39	B	13828	33828	43828
39	B	13830	33830	43830
39	B	13832	33832	43832
39	B	13834	33834	43834
39	B	13836	33836	43836
39	B	14110	34110	44170
39	B	14112	34112	44172
39	B	14114	34114	44174

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

		39	B	14116	34116	44176
		39	B	14118	34118	44178
		39	B	14120	34120	44180
		39	B	14122	34122	44182
		39	B	14124	34124	44184
		39	B	14126	34126	44186
		39	B	14128	34128	44188
		39	B	14130	34130	44190
		39	B	14132	34132	44192
		39	B	14134	34134	44194
		39	B	14136	34136	44196

40 TCT_40 ERROR ID. 40 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A FORWARDS VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04,RC05, RC11 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC05	RC11
40	A	10840	30840	40900		110660
40	A	10842	30842	40902		110662
40	A	10844	30844	40904		110664
40	A	10846	30846	40906		110666
40	A	10848	30848	40908		110668
40	A	10850	30850	40910		110670
40	A	10852	30852	40912		110672
40	A	10854	30854	40914		110674
40	A	10856	30856	40916		110676
40	A	10858	30858	40918		110678
40	A	10860	30860	40920		110680
40	A	10862	30862	40922		110682
40	A	10864	30864	40924		110684
40	A	10866	30866	40926		110686
40	B	13990	33990	44050	51250	113810
40	B	13992	33992	44052		113812
40	B	13994	33994	44054		113814
40	B	13996	33996	44056		113816
40	B	13998	33998	44058		113818
40	B	14000	34000	44060		113820
40	B	14002	34002	44062		113822
40	B	14004	34004	44064		113824
40	B	14006	34006	44066		113826
40	B	14008	34008	44068		113828
40	B	14010	34010	44070		113830
40	B	14012	34012	44072		113832
40	B	14014	34014	44074		113834
40	B	14016	34016	44076		113836

4.4 Reportos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
41	TCT_41	ERROR ID. 41 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A REPORTOS REPORTADOR ACTIVA RC01,RC04 VS PASIVA 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
41	A	10550		40550	
41	A	10552		40552	
41	A	10554		40554	
41	A	10556		40556	
41	A	10558		40558	
41	A	10560		40560	
41	A	10562		40562	
41	A	10564		40564	
41	A	10566		40566	
41	A	10568		40568	
41	A	10570		40570	
41	A	10572		40572	
41	A	10574		40574	
41	A	10576		40576	
41	B	13700	33700	43700	113700
41	B	13702	33702	43702	113702
41	B	13704	33704	43704	113704
41	B	13706	33706	43706	113706
41	B	13708	33708	43708	113708
41	B	13710	33710	43710	113710
41	B	13712	33712	43712	113712
41	B	13714	33714	43714	113714
41	B	13716	33716	43716	113716
41	B	13718	33718	43718	113718
41	B	13720	33720	43720	113720
41	B	13722	33722	43722	113722
41	B	13724	33724	43724	113724
41	B	13726	33726	43726	113726

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
42	TCT_42	ERROR ID. 42 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A REPORTOS REPORTADO ACTIVA RC01,RC03,RC04,RC11 VS PASIVA RC01,RC04	Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
42	A	10600	30600	40600	110600
42	A	10602	30602	40602	110602
42	A	10604	30604	40604	110604
42	A	10606	30606	40606	110606
42	A	10608	30608	40608	110608
42	A	10610	30610	40610	110610
42	A	10612	30612	40612	110612
42	A	10614	30614	40614	110614
42	A	10616	30616	40616	110616
42	A	10618	30618	40618	110618
42	A	10620	30620	40620	110620
42	A	10622	30622	40622	110622
42	A	10624	30624	40624	110624
42	A	10626	30626	40626	110626
42	B	13750		43750	
42	B	13752		43752	
42	B	13754		43754	
42	B	13756		43756	
42	B	13758		43758	
42	B	13760		43760	
42	B	13762		43762	
42	B	13764		43764	
42	B	13766		43766	
42	B	13768		43768	
42	B	13770		43770	
42	B	13772		43772	
42	B	13774		43774	
42	B	13776		43776	

4.5 Opciones

4.5.1 Opciones de Compra

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
43	TCT_43	ERROR ID. 43 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES COMPRA DIVISAS (ACTIVA) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC01, RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
43	A	11620	41620
43	A	11622	41622
43	A	11624	41624
43	A	11626	41626
43	A	11628	41628
43	A	11630	41630
43	A	11632	41632
43	A	11634	41634
43	A	11636	41636
43	A	11638	41638
43	A	11640	41640
43	A	11642	41642
43	A	11644	41644
43	A	11646	41646
43	A	-	41710
43	A	-	41712
43	A	-	41714
43	A	-	41716
43	A	-	41718
43	A	-	41720
43	A	-	41722
43	A	-	41724
43	A	-	41726
43	A	-	41728
43	A	-	41730
43	A	-	41732
43	A	-	41734
43	A	-	41736
43	B	14750	44720
43	B	14752	44722
43	B	14754	44724
43	B	14756	44726
43	B	14758	44728
43	B	14760	44730
43	B	14762	44732

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

43	B	14764	44734
43	B	14766	44736
43	B	14768	44738
43	B	14770	44740
43	B	14772	44742
43	B	14774	44744
43	B	14776	44746
43	B	-	44810
43	B	-	44812
43	B	-	44814
43	B	-	44816
43	B	-	44818
43	B	-	44820
43	B	-	44822
43	B	-	44824
43	B	-	44826
43	B	-	44828
43	B	-	44830
43	B	-	44832
43	B	-	44834
43	B	-	44836

44 TCT_44 ERROR ID. 44 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES COMPRA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04 — Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
44	A	11500	31500	41500
44	A	11502	31502	41502
44	A	11504	31504	41504
44	A	11506	31506	41506
44	A	11508	31508	41508
44	A	11510	31510	41510
44	A	11512	31512	41512
44	A	11514	31514	41514
44	A	11516	31516	41516
44	A	11518	31518	41518
44	A	11520	31520	41520
44	A	11522	31522	41522
44	A	11524	31524	41524
44	A	11526	31526	41526
44	A	11590	31590	41590
44	A	11592	31592	41592

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

44	A	11594	31594	41594	
44	A	11596	31596	41596	
44	A	11598	31598	41598	
44	A	11600	31600	41600	
44	A	11602	31602	41602	
44	A	11604	31604	41604	
44	A	11606	31606	41606	
44	A	11608	31608	41608	
44	A	11610	31610	41610	
44	A	11612	31612	41612	
44	A	11614	31614	41614	
44	A	11616	31616	41616	
44	B	14600	34600	44600	
44	B	14602	34602	44602	
44	B	14604	34604	44604	
44	B	14606	34606	44606	
44	B	14608	34608	44608	
44	B	14610	34610	44610	
44	B	14612	34612	44612	
44	B	14614	34614	44614	
44	B	14616	34616	44616	
44	B	14618	34618	44618	
44	B	14620	34620	44620	
44	B	14622	34622	44622	
44	B	14624	34624	44624	
44	B	14626	34626	44626	
44	B	14690	34690	44690	
44	B	14692	34692	44692	
44	B	14694	34694	44694	
44	B	14696	34696	44696	
44	B	14698	34698	44698	
44	B	14700	34700	44700	
44	B	14702	34702	44702	
44	B	14704	34704	44704	
44	B	14706	34706	44706	
44	B	14708	34708	44708	
44	B	14710	34710	44710	
44	B	14712	34712	44712	
44	B	14714	34714	44714	
44	B	14716	34716	44716	

45 TCT_45 ERROR ID. 45 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES COMPRA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05
45	A	11680	31620	41740	112830	50350
45	A	11682	31622	41742	112832	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		45	A	11684	31624	41744	112834		
		45	A	11686	31626	41746	112836		
		45	A	11688	31628	41748	112838		
		45	A	11690	31630	41750	112840		
		45	A	11692	31632	41752	112842		
		45	A	11694	31634	41754	112844		
		45	A	11696	31636	41756	112846		
		45	A	11698	31638	41758	112848		
		45	A	11700	31640	41760	112850		
		45	A	11702	31642	41762	112852		
		45	A	11704	31644	41764	112854		
		45	A	11706	31646	41766	112856		
		45	A	11770	31710	41830	112920		
		45	A	11772	31712	41832	112922		
		45	A	11774	31714	41834	112924		
		45	A	11776	31716	41836	112926		
		45	A	11778	31718	41838	112928		
		45	A	11780	31720	41840	112930		
		45	A	11782	31722	41842	112932		
		45	A	11784	31724	41844	112934		
		45	A	11786	31726	41846	112936		
		45	A	11788	31728	41848	112938		
		45	A	11790	31730	41850	112940		
		45	A	11792	31732	41852	112942		
		45	A	11794	31734	41854	112944		
		45	A	11796	31736	41856	112946		
		45	B	14780	34720	44840	115850	51300	
		45	B	14782	34722	44842	115852		
		45	B	14784	34724	44844	115854		
		45	B	14786	34726	44846	115856		
		45	B	14788	34728	44848	115858		
		45	B	14790	34730	44850	115860		
		45	B	14792	34732	44852	115862		
		45	B	14794	34734	44854	115864		
		45	B	14796	34736	44856	115866		
		45	B	14798	34738	44858	115868		
		45	B	14800	34740	44860	115870		
		45	B	14802	34742	44862	115872		
		45	B	14804	34744	44864	115874		
		45	B	14806	34746	44866	115876		
		45	B	14870	34810	44930	115940		
		45	B	14872	34812	44932	115942		
		45	B	14874	34814	44934	115944		
		45	B	14876	34816	44936	115946		
		45	B	14878	34818	44938	115948		
		45	B	14880	34820	44940	115950		
		45	B	14882	34822	44942	115952		
		45	B	14884	34824	44944	115954		
		45	B	14886	34826	44946	115956		
		45	B	14888	34828	44948	115958		
		45	B	14890	34830	44950	115960		
		45	B	14892	34832	44952	115962		
		45	B	14894	34834	44954	115964		
		45	B	14896	34836	44956	115966		

4.5.2 Opciones de Venta

Contenido

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
46	TCT_46	ERROR ID. 46 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES VENTA DIVISAS (ACTIVA) RC01, RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04
46	A	11650	41650
46	A	11652	41652
46	A	11654	41654
46	A	11656	41656
46	A	11658	41658
46	A	11660	41660
46	A	11662	41662
46	A	11664	41664
46	A	11666	41666
46	A	11668	41668
46	A	11670	41670
46	A	11672	41672
46	A	11674	41674
46	A	11676	41676
46	A		41680
46	A		41682
46	A		41684
46	A		41686
46	A		41688
46	A		41690
46	A		41692
46	A		41694
46	A		41696
46	A		41698
46	A		41700
46	A		41702
46	A		41704
46	A		41706
46	B	14720	44750
46	B	14722	44752
46	B	14724	44754
46	B	14726	44756
46	B	14728	44758
46	B	14730	44760
46	B	14732	44762
46	B	14734	44764
46	B	14736	44766
46	B	14738	44768

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

46	B	14740	44770
46	B	14742	44772
46	B	14744	44774
46	B	14746	44776
46	B	-	44780
46	B	-	44782
46	B	-	44784
46	B	-	44786
46	B	-	44788
46	B	-	44790
46	B	-	44792
46	B	-	44794
46	B	-	44796
46	B	-	44798
46	B	-	44800
46	B	-	44802
46	B	-	44804
46	B	-	44806

47 TCT_47 ERROR ID. 47 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES VENTA TASA INTERÉS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04 VS TASA INTERÉS (PASIVA) RC01,RC03,RC04 Grave

***Algoritmo*:**

$$|A-B| <= 0.1\ A$$

Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04
47	A	11530	31530	41530
47	A	11532	31532	41532
47	A	11534	31534	41534
47	A	11536	31536	41536
47	A	11538	31538	41538
47	A	11540	31540	41540
47	A	11542	31542	41542
47	A	11544	31544	41544
47	A	11546	31546	41546
47	A	11548	31548	41548
47	A	11550	31550	41550
47	A	11552	31552	41552
47	A	11554	31554	41554
47	A	11556	31556	41556
47	A	11560	31560	41560
47	A	11562	31562	41562
47	A	11564	31564	41564
47	A	11566	31566	41566
47	A	11568	31568	41568
47	A	11570	31570	41570
47	A	11572	31572	41572
47	A	11574	31574	41574
47	A	11576	31576	41576
47	A	11578	31578	41578

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

47	A	11580	31580	41580	
47	A	11582	31582	41582	
47	A	11584	31584	41584	
47	A	11586	31586	41586	
47	B	14630	34630	44630	
47	B	14632	34632	44632	
47	B	14634	34634	44634	
47	B	14636	34636	44636	
47	B	14638	34638	44638	
47	B	14640	34640	44640	
47	B	14642	34642	44642	
47	B	14644	34644	44644	
47	B	14646	34646	44646	
47	B	14648	34648	44648	
47	B	14650	34650	44650	
47	B	14652	34652	44652	
47	B	14654	34654	44654	
47	B	14656	34656	44656	
47	B	14660	34660	44660	
47	B	14662	34662	44662	
47	B	14664	34664	44664	
47	B	14666	34666	44666	
47	B	14668	34668	44668	
47	B	14670	34670	44670	
47	B	14672	34672	44672	
47	B	14674	34674	44674	
47	B	14676	34676	44676	
47	B	14678	34678	44678	
47	B	14680	34680	44680	
47	B	14682	34682	44682	
47	B	14684	34684	44684	
47	B	14686	34686	44686	

48 TCT_48 ERROR ID. 48 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A OPCIONES VENTA OTROS SUBYACENTES (ACTIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 VS OTROS SUBYACENTES (PASIVA) RC01,RC03,RC04,RC05 Grave

***Algoritmo*:**

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05
48	A	11710	31650	41770	112860	50300
48	A	11712	31652	41772	112862	
48	A	11714	31654	41774	112864	
48	A	11716	31656	41776	112866	
48	A	11718	31658	41778	112868	
48	A	11720	31660	41780	112870	
48	A	11722	31662	41782	112872	
48	A	11724	31664	41784	112874	
48	A	11726	31666	41786	112876	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo							Nivel
		48	A	11728	31668	41788	112878		
		48	A	11730	31670	41790	112880		
		48	A	11732	31672	41792	112882		
		48	A	11734	31674	41794	112884		
		48	A	11736	31676	41796	112886		
		48	A	11740	31680	41800	112890		
		48	A	11742	31682	41802	112892		
		48	A	11744	31684	41804	112894		
		48	A	11746	31686	41806	112896		
		48	A	11748	31688	41808	112898		
		48	A	11750	31690	41810	112900		
		48	A	11752	31692	41812	112902		
		48	A	11754	31694	41814	112904		
		48	A	11756	31696	41816	112906		
		48	A	11758	31698	41818	112908		
		48	A	11760	31700	41820	112910		
		48	A	11762	31702	41822	112912		
		48	A	11764	31704	41824	112914		
		48	A	11766	31706	41826	112916		
		48	B	14810	34750	44870	115880	51350	
		48	B	14812	34752	44872	115882		
		48	B	14814	34754	44874	115884		
		48	B	14816	34756	44876	115886		
		48	B	14818	34758	44878	115888		
		48	B	14820	34760	44880	115890		
		48	B	14822	34762	44882	115892		
		48	B	14824	34764	44884	115894		
		48	B	14826	34766	44886	115896		
		48	B	14828	34768	44888	115898		
		48	B	14830	34770	44890	115900		
		48	B	14832	34772	44892	115902		
		48	B	14834	34774	44894	115904		
		48	B	14836	34776	44896	115906		
		48	B	14840	34780	44900	115910		
		48	B	14842	34782	44902	115912		
		48	B	14844	34784	44904	115914		
		48	B	14846	34786	44906	115916		
		48	B	14848	34788	44908	115918		
		48	B	14850	34790	44910	115920		
		48	B	14852	34792	44912	115922		
		48	B	14854	34794	44914	115924		
		48	B	14856	34796	44916	115926		
		48	B	14858	34798	44918	115928		
		48	B	14860	34800	44920	115930		
		48	B	14862	34802	44922	115932		
		48	B	14864	34804	44924	115934		
		48	B	14866	34806	44926	115936		

Contenido

4.6 Compra y Venta de Divisas Fecha Valor

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>49</td><td>TCT_49</td><td>ERROR ID. 49 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A COMPRA DIVISAS (ACTIVA) RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC01,RC04

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></tr><tr><td>49</td><td>A</td><td></td><td>40195</td></tr><tr><td>49</td><td>B</td><td>13240</td><td>43195</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>50</td><td>TCT_50</td><td>ERROR ID. 50 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A VENTA DIVISAS (ACTIVA) RC01,RC04 VS DIVISAS (PASIVA) RC04

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></tr><tr><td>50</td><td>A</td><td>10195</td><td>40197</td></tr><tr><td>50</td><td>B</td><td></td><td>43197</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

4.7 Compra y Venta de Títulos de Deuda Fecha Valor

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
51	TCT_51	ERROR ID. 51 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A CVT FECHA VALOR COMPRA TITULOS (ACTIVA) RC01,RC03,RC04,RC11 VS DINERO (PASIVA) RC01,RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11
51	A	10300	30300	40300	110300
51	A	10302	30302	40302	110302
51	A	10304	30304	40304	110304
51	A	10306	30306	40306	110306
51	A	10308	30308	40308	110308
51	A	10310	30310	40310	110310
51	A	10312	30312	40312	110312
51	A	10314	30314	40314	110314
51	A	10316	30316	40316	110316
51	A	10318	30318	40318	110318
51	A	10320	30320	40320	110320
51	A	10322	30322	40322	110322
51	A	10324	30324	40324	110324
51	A	10326	30326	40326	110326
51	B	13400		43400	
51	B	14901		44959	

52	TCT_52	ERROR ID. 52 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A CVT FECHA VALOR VENTA DINERO (ACTIVA) RC01,RC04 VS TITULOS (PASIVA) 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
52	A	10200		40200	
52	A	11801		41859	
52	B	13500	33500	43500	113500
52	B	13502	33502	43502	113502
52	B	13504	33504	43504	113504
52	B	13506	33506	43506	113506
52	B	13508	33508	43508	113508
52	B	13510	33510	43510	113510

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel

52	B	13512	33512	43512	113512
52	B	13514	33514	43514	113514
52	B	13516	33516	43516	113516
52	B	13518	33518	43518	113518
52	B	13520	33520	43520	113520
52	B	13522	33522	43522	113522
52	B	13524	33524	43524	113524
52	B	13526	33526	43526	113526

4.8 Compra y Venta de Acciones Fecha Valor

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
53	TCT_53	ERROR ID. 53 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A COMPRA ACCIONES (VALORES) A RECIBIR RC05 VS DINERO A ENTREGAR RC01,RC04	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.01 A
Con tolerancia de 1%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC04	RC05
53	A			50050
53	B	13401	43401	
53	B	14900	44960	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
54	TCT_54	ERROR ID. 54 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO (ACTIVOS BRUTOS) VS (PASIVOS BRUTOS), RELATIVO A VENTA DINERO A RECIBIR RC01,RC04 VS ACCIONES (VALORES) A ENTREGAR RC05	Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.01 A
Con tolerancia de 1%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	CONCEPTO DE LA VALIDACION	RC01	RC04	RC05
54	A	541	10201	40201	
54	A	541	11800	41860	
54	B	542			51050

Tipo 5.- Crédito (RC09) vs Crédito (RC08)

5.1 Cargos Diferidos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
55	TCT_55	ERROR ID. 55 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: CAPITAL RC09 (93755) VS CRÉDITO RC08 (84903), RELATIVO A CARGOS DIFERIDOS MENORES A 1 AÑO REGISTRADOS EN AMBOS FORMULARIOS, QUE NO SE RESTAN DEL CAPITAL ***Algoritmo***: **A – B =0** **Con tolerancia de 0%** ***Dónde:***	Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC08	RC09
55	A		93755
55	B	84903	

Tipo 6.- Mercado vs Crédito Contraparte

6.1 Total de Operaciones de Reporto, Swaps, Forwards y Préstamos

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
60	TCT_60	ERROR ID. 60 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A ACTIVOS A RECIBIR, POR OPERACIONES CON INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN NIVEL DE RGO. CONFORME A CALIDAD CREDITICIA OTORGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS ***Algoritmo***: **|A-B| <= 0.1 A** **Con tolerancia de 10%** ***Dónde:***	No Grave

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05	RC06
60	A	10600	30600	40600	110600	50250	
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	A	10550	31050	40550	111080			
	60	A	10552	31052	40552	111082			
	60	A	10554	31054	40554	111084			
	60	A	10556	31056	40556	111086			
	60	A	10558	31058	40558	111088			
	60	A	10560	31060	40560	111090			
	60	A	10562	31062	40562	111092			
	60	A	10564	31064	40564	111094			
	60	A	10566	31066	40566	111096			
	60	A	10568	31068	40568	111098			
	60	A	10570	31070	40570	111100			
	60	A	10572	31072	40572	111102			
	60	A	10574	31074	40574	111104			
	60	A	10576	31076	40576	111106			
	60	A	11050	31080	41110	110630			
	60	A	11052	31082	41112	110632			
	60	A	11054	31084	41114	110634			
	60	A	11056	31086	41116	110636			
	60	A	11058	31088	41118	110638			
	60	A	11060	31090	41120	110640			
	60	A	11062	31092	41122	110642			
	60	A	11064	31094	41124	110644			
	60	A	11066	31096	41126	110646			
	60	A	11068	31098	41128	110648			
	60	A	11070	31100	41130	110650			
	60	A	11072	31102	41132	110652			
	60	A	11074	31104	41134	110654			
	60	A	11076	31106	41136	110656			
	60	A	11080	31110	41140	110660			
	60	A	11082	31112	41142	110662			
	60	A	11084	31114	41144	110664			
	60	A	11086	31116	41146	110666			
	60	A	11088	31118	41148	110668			
	60	A	11090	31120	41150	110670			
	60	A	11092	31122	41152	110672			
	60	A	11094	31124	41154	110674			
	60	A	11096	31126	41156	110676			
	60	A	11098	31128	41158	110678			
	60	A	11100	31130	41160	110680			
	60	A	11102	31132	41162	110682			
	60	A	11104	31134	41164	110684			
	60	A	11106	31136	41166	110686			
	60	A	11110	30630	41170	110500			
	60	A	11112	30632	41172	110502			
	60	A	11114	30634	41174	110504			
	60	A	11116	30636	41176	110506			
	60	A	11118	30638	41178	110508			
	60	A	11120	30640	41180	110510			
	60	A	11122	30642	41182	110512			
	60	A	11124	30644	41184	110514			
	60	A	11126	30646	41186	110516			
	60	A	11128	30648	41188	110518			
	60	A	11130	30650	41190	110520			
	60	A	11132	30652	41192	110522			
	60	A	11134	30654	41194	110524			

	60	A	11136	30656	41196	110526			
	60	A	10630	30930	40750				
	60	A	10632	30932	40752				
	60	A	10634	30934	40754				
	60	A	10636	30936	40756				
	60	A	10638	30938	40758				
	60	A	10640	30940	40760				
	60	A	10642	30942	40762				
	60	A	10644	30944	40764				
	60	A	10646	30946	40766				
	60	A	10648	30948	40768				
	60	A	10650	30950	40770				
	60	A	10652	30952	40772				
	60	A	10654	30954	40774				
	60	A	10656	30956	40776				
	60	A	10930	30810	40630				
	60	A	10932	30812	40632				
	60	A	10934	30814	40634				
	60	A	10936	30816	40636				
	60	A	10938	30818	40638				
	60	A	10940	30820	40640				
	60	A	10942	30822	40642				
	60	A	10944	30824	40644				
	60	A	10946	30826	40646				
	60	A	10948	30828	40648				
	60	A	10950	30830	40650				
	60	A	10952	30832	40652				
	60	A	10954	30834	40654				
	60	A	10956	30836	40656				
	60	A	10810	30660	40990				
	60	A	10812	30662	40992				
	60	A	10814	30664	40994				
	60	A	10816	30666	40996				
	60	A	10818	30668	40998				
	60	A	10820	30670	41000				
	60	A	10822	30672	41002				
	60	A	10824	30674	41004				
	60	A	10826	30676	41006				
	60	A	10828	30678	41008				
	60	A	10830	30680	41010				
	60	A	10832	30682	41012				
	60	A	10834	30684	41014				
	60	A	10836	30686	41016				
	60	A	10750	30960	40870				
	60	A	10752	30962	40872				
	60	A	10754	30964	40874				
	60	A	10756	30966	40876				
	60	A	10758	30968	40878				
	60	A	10760	30970	40880				
	60	A	10762	30972	40882				
	60	A	10764	30974	40884				
	60	A	10766	30976	40886				
	60	A	10768	30978	40888				
	60	A	10770	30980	40890				
	60	A	10772	30982	40892				
	60	A	10774	30984	40894				
	60	A	10776	30986	40896				
	60	A	10660	30840	40780				
	60	A	10662	30842	40782				
	60	A	10664	30844	40784				

	60	A	10666	30846	40786				
	60	A	10668	30848	40788				
	60	A	10670	30850	40790				
	60	A	10672	30852	40792				
	60	A	10674	30854	40794				
	60	A	10676	30856	40796				
	60	A	10678	30858	40798				
	60	A	10680	30860	40800				
	60	A	10682	30862	40802				
	60	A	10684	30864	40804				
	60	A	10686	30866	40806				
	60	A	10960	30500	40660				
	60	A	10962	30502	40662				
	60	A	10964	30504	40664				
	60	A	10966	30506	40666				
	60	A	10968	30508	40668				
	60	A	10970	30510	40670				
	60	A	10972	30512	40672				
	60	A	10974	30514	40674				
	60	A	10976	30516	40676				
	60	A	10978	30518	40678				
	60	A	10980	30520	40680				
	60	A	10982	30522	40682				
	60	A	10984	30524	40684				
	60	A	10986	30526	40686				
	60	A	10840		41020				
	60	A	10842		41022				
	60	A	10844		41024				
	60	A	10846		41026				
	60	A	10848		41028				
	60	A	10850		41030				
	60	A	10852		41032				
	60	A	10854		41034				
	60	A	10856		41036				
	60	A	10858		41038				
	60	A	10860		41040				
	60	A	10862		41042				
	60	A	10864		41044				
	60	A	10866		41046				
	60	A	10500		40900				
	60	A	10502		40902				
	60	A	10504		40904				
	60	A	10506		40906				
	60	A	10508		40908				
	60	A	10510		40910				
	60	A	10512		40912				
	60	A	10514		40914				
	60	A	10516		40916				
	60	A	10518		40918				
	60	A	10520		40920				
	60	A	10522		40922				
	60	A	10524		40924				
	60	A	10526		40926				
	60	A			40500				
	60	A			40502				
	60	A			40504				
	60	A			40506				
	60	A			40508				
	60	A			40510				
	60	A			40512				

	60	A			40514				
	60	A			40516				
	60	A			40518				
	60	A			40520				
	60	A			40522				
	60	A			40524				
	60	A			40526				
	60	B						69110	
	60	B						69115	
	60	B						60310	
	60	B						60361	
	60	B						60410	
	60	B						60462	
	60	B						60510	
	60	B						60563	
	60	B						60010	
	60	B						60061	
	60	B						60110	
	60	B						60162	
	60	B						60210	
	60	B						60263	
	60	B						60610	
	60	B						60661	
	60	B						60710	
	60	B						60762	
	60	B						60810	
	60	B						60863	
	60	B						61510	
	60	B						61561	
	60	B						61610	
	60	B						61662	
	60	B						61710	
	60	B						61763	
	60	B						62110	
	60	B						62161	
	60	B						62210	
	60	B						62262	
	60	B						62310	
	60	B						62363	
	60	B						63310	
	60	B						63361	
	60	B						63410	
	60	B						63462	
	60	B						63510	
	60	B						63563	
	60	B						61810	
	60	B						61861	
	60	B						61910	
	60	B						61962	
	60	B						62010	
	60	B						62063	
	60	B						62410	
	60	B						62461	
	60	B						62510	
	60	B						62562	
	60	B						62610	
	60	B						62663	
	60	B						63610	
	60	B						63661	
	60	B						63710	

	60	B						63762	
	60	B						63810	
	60	B						63863	
	60	B						63910	
	60	B						63961	
	60	B						64010	
	60	B						64062	
	60	B						64110	
	60	B						64163	

No. Validación	Nombre	Descripción/ Algoritmo	Nivel
61	TCT_61	ERROR ID. 61 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO CONTRAPARTE, RELATIVO A PASIVOS A ENTREGAR, POR OPERACIONES CON INSTITUCIONES DE BANCA MÚLTIPLE QUE NO REVELEN NIVEL DE RGO. CONFORME A CALIDAD CREDITICIA OTORGADA POR AGENCIAS CALIFICADORAS	No Grave

Algoritmo:

|A-B| <= 0.1 A
Con tolerancia de 10%

Dónde:

ID VALIDACIÓN	ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN	RC01	RC03	RC04	RC11	RC05	RC06
61	A	13700	33700	43700	113700	51250	
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	A	13750	34200	43750	114230		
61	A	13752	34202	43752	114232		
61	A	13754	34204	43754	114234		
61	A	13756	34206	43756	114236		
61	A	13758	34208	43758	114238		
61	A	13760	34210	43760	114240		
61	A	13762	34212	43762	114242		
61	A	13764	34214	43764	114244		
61	A	13766	34216	43766	114246		
61	A	13768	34218	43768	114248		
61	A	13770	34220	43770	114250		
61	A	13772	34222	43772	114252		
61	A	13774	34224	43774	114254		
61	A	13776	34226	43776	114256		
61	A	14200	34230	44260	113780		
61	A	14202	34232	44262	113782		
61	A	14204	34234	44264	113784		

	61	A	14206	34236	44266	113786			
	61	A	14208	34238	44268	113788			
	61	A	14210	34240	44270	113790			
	61	A	14212	34242	44272	113792			
	61	A	14214	34244	44274	113794			
	61	A	14216	34246	44276	113796			
	61	A	14218	34248	44278	113798			
	61	A	14220	34250	44280	113800			
	61	A	14222	34252	44282	113802			
	61	A	14224	34254	44284	113804			
	61	A	14226	34256	44286	113806			
	61	A	14230	34260	44290	113810			
	61	A	14232	34262	44292	113812			
	61	A	14234	34264	44294	113814			
	61	A	14236	34266	44296	113816			
	61	A	14238	34268	44298	113818			
	61	A	14240	34270	44300	113820			
	61	A	14242	34272	44302	113822			
	61	A	14244	34274	44304	113824			
	61	A	14246	34276	44306	113826			
	61	A	14248	34278	44308	113828			
	61	A	14250	34280	44310	113830			
	61	A	14252	34282	44312	113832			
	61	A	14254	34284	44314	113834			
	61	A	14256	34286	44316	113836			
	61	A	14260	33780	44320	113650			
	61	A	14262	33782	44322	113652			
	61	A	14264	33784	44324	113654			
	61	A	14266	33786	44326	113656			
	61	A	14268	33788	44328	113658			
	61	A	14270	33790	44330	113660			
	61	A	14272	33792	44332	113662			
	61	A	14274	33794	44334	113664			
	61	A	14276	33796	44336	113666			
	61	A	14278	33798	44338	113668			
	61	A	14280	33800	44340	113670			
	61	A	14282	33802	44342	113672			
	61	A	14284	33804	44344	113674			
	61	A	14286	33806	44346	113676			
	61	A	13900	34080	43900				
	61	A	13902	34082	43902				
	61	A	13904	34084	43904				
	61	A	13906	34086	43906				
	61	A	13908	34088	43908				
	61	A	13910	34090	43910				
	61	A	13912	34092	43912				
	61	A	13914	34094	43914				
	61	A	13916	34096	43916				
	61	A	13918	34098	43918				
	61	A	13920	34100	43920				
	61	A	13922	34102	43922				
	61	A	13924	34104	43924				
	61	A	13926	34106	43926				
	61	A	13780	33960	43780				
	61	A	13782	33962	43782				
	61	A	13784	33964	43784				
	61	A	13786	33966	43786				
	61	A	13788	33968	43788				
	61	A	13790	33970	43790				
	61	A	13792	33972	43792				

	61	A	13794	33974	43794				
	61	A	13796	33976	43796				
	61	A	13798	33978	43798				
	61	A	13800	33980	43800				
	61	A	13802	33982	43802				
	61	A	13804	33984	43804				
	61	A	13806	33986	43806				
	61	A	14080	33810	44140				
	61	A	14082	33812	44142				
	61	A	14084	33814	44144				
	61	A	14086	33816	44146				
	61	A	14088	33818	44148				
	61	A	14090	33820	44150				
	61	A	14092	33822	44152				
	61	A	14094	33824	44154				
	61	A	14096	33826	44156				
	61	A	14098	33828	44158				
	61	A	14100	33830	44160				
	61	A	14102	33832	44162				
	61	A	14104	33834	44164				
	61	A	14106	33836	44166				
	61	A	13960	34110	44020				
	61	A	13962	34112	44022				
	61	A	13964	34114	44024				
	61	A	13966	34116	44026				
	61	A	13968	34118	44028				
	61	A	13970	34120	44030				
	61	A	13972	34122	44032				
	61	A	13974	34124	44034				
	61	A	13976	34126	44036				
	61	A	13978	34128	44038				
	61	A	13980	34130	44040				
	61	A	13982	34132	44042				
	61	A	13984	34134	44044				
	61	A	13986	34136	44046				
	61	A	13810	33990	43930				
	61	A	13812	33992	43932				
	61	A	13814	33994	43934				
	61	A	13816	33996	43936				
	61	A	13818	33998	43938				
	61	A	13820	34000	43940				
	61	A	13822	34002	43942				
	61	A	13824	34004	43944				
	61	A	13826	34006	43946				
	61	A	13828	34008	43948				
	61	A	13830	34010	43950				
	61	A	13832	34012	43952				
	61	A	13834	34014	43954				
	61	A	13836	34016	43956				
	61	A	14110	33650	43810				
	61	A	14112	33652	43812				
	61	A	14114	33654	43814				
	61	A	14116	33656	43816				
	61	A	14118	33658	43818				
	61	A	14120	33660	43820				
	61	A	14122	33662	43822				
	61	A	14124	33664	43824				
	61	A	14126	33666	43826				
	61	A	14128	33668	43828				
	61	A	14130	33670	43830				

	61	A	14132	33672	43832				
	61	A	14134	33674	43834				
	61	A	14136	33676	43836				
	61	A	13990		44170				
	61	A	13992		44172				
	61	A	13994		44174				
	61	A	13996		44176				
	61	A	13998		44178				
	61	A	14000		44180				
	61	A	14002		44182				
	61	A	14004		44184				
	61	A	14006		44186				
	61	A	14008		44188				
	61	A	14010		44190				
	61	A	14012		44192				
	61	A	14014		44194				
	61	A	14016		44196				
	61	A	13650		44050				
	61	A	13652		44052				
	61	A	13654		44054				
	61	A	13656		44056				
	61	A	13658		44058				
	61	A	13660		44060				
	61	A	13662		44062				
	61	A	13664		44064				
	61	A	13666		44066				
	61	A	13668		44068				
	61	A	13670		44070				
	61	A	13672		44072				
	61	A	13674		44074				
	61	A	13676		44076				
	61	A			43650				
	61	A			43652				
	61	A			43654				
	61	A			43656				
	61	A			43658				
	61	A			43660				
	61	A			43662				
	61	A			43664				
	61	A			43666				
	61	A			43668				
	61	A			43670				
	61	A			43672				
	61	A			43674				
	61	A			43676				
	61	B						69120	
	61	B						69225	
	61	B						60020	
	61	B						60071	
	61	B						60120	
	61	B						60172	
	61	B						60220	
	61	B						60273	
	61	B						60320	
	61	B						60371	
	61	B						60420	
	61	B						60472	
	61	B						60520	
	61	B						60573	
	61	B						60620	

	61	B						60671
	61	B						60720
	61	B						60772
	61	B						60820
	61	B						60873
	61	B						61520
	61	B						61571
	61	B						61620
	61	B						61672
	61	B						61720
	61	B						61773
	61	B						62120
	61	B						62171
	61	B						62220
	61	B						62272
	61	B						62320
	61	B						62373
	61	B						63320
	61	B						63371
	61	B						63420
	61	B						63472
	61	B						63520
	61	B						63573
	61	B						61820
	61	B						61871
	61	B						61920
	61	B						61972
	61	B						62020
	61	B						62073
	61	B						62420
	61	B						62471
	61	B						62520
	61	B						62572
	61	B						62620
	61	B						62673
	61	B						63620
	61	B						63671
	61	B						63720
	61	B						63772
	61	B						63820
	61	B						63873
	61	B						69300
	61	B						69320
	61	B						69350
	61	B						69370
	61	B						69400
	61	B						69420

<table>
<tr><th>No. Validación</th><th>Nombre</th><th>Descripción/ Algoritmo</th><th>Nivel</th></tr>
<tr><td>62</td><td>TCT_62</td><td>ERROR ID. 62 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A POSICIÓN TOTAL LARGA DEL PORTAFOLIO DE CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS

Algoritmo:
|A-B| <= 0
Con tolerancia de 0%

Dónde:
<table><tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC05</th><th>RC07</th></tr><tr><td>62</td><td>A</td><td>50700</td><td></td></tr><tr><td>62</td><td>B</td><td></td><td>77033</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
<tr><td>63</td><td>TCT_63</td><td>ERROR ID. 63 VALIDACIÓN ENTRE SECCIONES: MERCADO VS CRÉDITO EMISOR, RELATIVO A POSICIÓN TOTAL CORTA DEL PORTAFOLIO DE CERTIFICADOS BURSÁTILES FIDUCIARIOS INMOBILIARIOS, DE DESARROLLO E INDIZADOS

Algoritmo:
|A-B| <= 0
Con tolerancia de 0%

Dónde:
<table><tr><th>ID VALIDACIÓN</th><th>ELEMENTO DE LA VALIDACIÓN</th><th>RC05</th><th>RC07</th></tr><tr><td>63</td><td>A</td><td>51700</td><td></td></tr><tr><td>63</td><td>B</td><td></td><td>77133</td></tr></table></td><td>Grave</td></tr>
</table>

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 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.

RC09

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
3	Capital Básico	El concepto "Capital Básico" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico. ***Algoritmo***: ***94150 = 101813*** ****Cálculo Banco de México conforme CUB***	Grave
No. Validación	**Nombre**	**Descripción/ *Algoritmo***	**Nivel**
4	Capital Complementario	El concepto "Capital Complementario" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico. ***Algoritmo***: ***94200 = 101814*** ****Cálculo Banco de México conforme CUB***	Grave
No. Validación	**Nombre**	**Descripción/ *Algoritmo***	**Nivel**
5	Capital Neto	El concepto "Capital Neto" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico. ***Algoritmo***: ***94504 = 101815*** ****Cálculo Banco de México conforme CUB***	Grave

No. Validación	Nombre	Descripción/ *Algoritmo*	Nivel
6	Índice de Capitalización	El concepto "Índice de Capitalización" reportado en el RC09 debe coincidir con el Cálculo Banxico. ***Algoritmo***: ***94300 = 100834*** ****Cálculo Banco de México conforme CUB***	Grave
No. Validación	**Nombre**	**Descripción/ *Algoritmo***	**Nivel**
8,9 ,10, 11 ,12	Índice de Capital de la Filial	El concepto "Índice de Capital" de la Filial, debe ser distinto de Cero ***Algoritmo***: ***Condición Previa*** ***SI INST = CASA DE BOLSA CON FILIAL Y EL CONCEPTO 100834 <> 0*** ***Condición Base*** ***DIAGNOSTICO POST CÓMPUTO = FALSO SI Y SOLO SI CONCEPTO =100834 <> 0 PARA LA INSTITUCIÓN FILIAL***	Grave