



Requerimiento de información regulatoria

FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES

Octubre 2024

Uso Público

Información de acceso público.

Contenido

Fundamento legal	4
Ley del Banco de México, primer párrafo del artículo 36.	4
Reglas de operaciones de REPORTO, numeral 10.	4
Ley para regular las Instituciones de Tecnología Financiera, artículo 57.	4
Ley para regular las Instituciones de Tecnología Financiera, artículo 70.	4
Circular 12/2018, Capítulo IV, disposición 39.a.	4
Circular 6/2019, Capítulo II, disposición 6.a.	5
Contacto para dudas y comentarios	5
Objetivo	5
Definiciones	6
Calendario de entrega de información	7
Transmisiones fuera de tiempo	8
Retransmisiones	8
Entidades que deberán reportar	8
Descripción metodológica	9
Metodología	9
Sección 1	9
Sección 2	9
Sección 3	9
Sección 4	9
Sección 5	9
Metodología de confrontas	10
Especificaciones	11
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS	11
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA	13
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VALORES OBJETO DEL REPORTO (CANASTA DE COLATERALES Y SUSTITUCIÓN DE VALORES).	15
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VENCIMIENTOS ANTICIPADOS	16
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A LA MODIFICACIÓN DE LA TASA PREMIO	16
Ayudas específicas para los campos de cada sección	18

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS.....	18
AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.....	22
AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A VALORES OBJETO DEL REPORTO (CANASTA DE COLATERALES Y SUSTITUCIÓN DE VALORES).....	27
AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A VENCIMIENTOS ANTICIPADOS.....	30
AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A LA MODIFICACIÓN DE LA TASA PREMIO. .	31
Catálogos.....	32
Catálogo de Corros Electrónicos	32
Catálogo de Posiciones en Reportos.....	32
Catálogo de Claves de Banco de Trabajo	32
Catálogo de Tipos de Postura.....	32
Catálogo de Motivos Vencimiento Anticipado.....	33
Catálogo de Modalidades Especiales de Reporto	33
Catálogo de Tasas de Referencia	33

Fundamento legal

Ley del Banco de México, primer párrafo del artículo 36.

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

Reglas de operaciones de REPORTO, numeral 10.

“Las Entidades¹ y los Almacenes Generales de Depósito deberán proporcionar a las Autoridades, en términos de las disposiciones aplicables, la información sobre los Reportos que celebren, en la forma y plazos que estas les requieran”.

Ley para regular las Instituciones de Tecnología Financiera, artículo 57.

“Las ITF deberán reportar a la CNBV, a la CONDUSEF y al Banco de México, en el ámbito de sus respectivas competencias, aquella información relacionada con sus actividades y las Operaciones que determine la Autoridad Financiera que corresponda en disposiciones de carácter general, con la periodicidad que en dichas disposiciones se señale”.

Ley para regular las Instituciones de Tecnología Financiera, artículo 70.

“Las ITF estarán obligadas a proporcionar a la CNBV y al Banco de México, en el ámbito de sus respectivas competencias, la información que dichas Autoridades Financieras les requieran sobre sus Operaciones y aquellas realizadas entre sus Clientes, incluso respecto de alguna o algunas de ellas en lo individual, los datos que permitan estimar su situación financiera y, en general, aquella que sea útil a la CNBV o al Banco de México para proveer el adecuado cumplimiento de sus funciones, en la forma y términos que las propias Autoridades determinen.

El cumplimiento de las obligaciones señaladas en este artículo no implicará trasgresión alguna a la obligación de confidencialidad legal, ni constituirá violación a las restricciones sobre revelación de información establecidas por vía contractual”.

Circular 12/2018, Capítulo IV, disposición 39.a.

Obligación de suministrar información al Banco de México.

“Las instituciones de fondos de pago electrónico estarán obligadas a suministrar al Banco de México la información transaccional de las Transferencias de Fondos y Transferencias de Fondos de Pago

¹ Se define como ‘Entidades’ a las instituciones de crédito, casas de bolsa, fondos de inversión, sociedades de inversión de fondos para el retiro, almacenes generales de depósito, instituciones de seguros, instituciones de fianzas y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas que mantengan vínculos patrimoniales con una institución de crédito.

Electrónico enviadas y recibidas por sus Clientes en los términos que al efecto el Banco de México determine.

Sin perjuicio de lo anterior, las instituciones de fondos de pago electrónicos deberán entregar toda la información que el Banco de México les requiera, en los términos y plazos que les indique”.

Circular 6/2019, Capítulo II, disposición 6.a.

Obligación de suministrar información al Banco de México.

“Las instituciones de financiamiento colectivo estarán obligadas a suministrar al Banco de México la información transaccional de sus Operaciones, en los términos que al efecto determine el Banco de México.

Sin perjuicio de lo anterior, las instituciones de financiamiento colectivo deberán entregar toda la información que el Banco de México les requiera, en los términos y plazos que les indique”.

Contacto para dudas y comentarios

Oficina	Oficina de Información de Mercado de Dinero
Correo electrónico	cvtreportos@banxico.org.mx / titulos@banxico.org.mx

Objetivo

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

Definiciones

Concepto	Descripción
Agente tripartito	Entidad que provee, entre otros, servicios relacionados con la custodia y administración de los valores objeto de las operaciones de Reporto y de administración de las garantías, como los señalados en el numeral 2.8 de las reglas de Reportos.
Bloque	Archivo que contiene todas las operaciones de reportos relativas a una misma fecha de concertación, de vencimiento anticipado o de corte.
Canasta de valores	Conjunto de valores objeto del reporto.
Confronta	Es la revisión y comparación de dos o más conjuntos de Información financiera para verificar su exactitud y consistencia. Es un proceso de control que permite identificar inconsistencias con otras fuentes de información.
Corro electrónico	Empresa que proporciona los mecanismos (sistemas de negociación) tendientes a facilitar las operaciones con valores.
Depositorio de Valores	Entidad autorizada para actuar como tal, que se encuentre establecida en México o en alguno de los Países de Referencia.
Día hábil bancario	Día calendario distinto a aquel en que las Instituciones de Crédito deban cerrar sus puertas y suspender operaciones, en términos de las disposiciones de carácter general que, para tal efecto, emita la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.
Evergreen Repo	Reportos conocidos como reportos siempre vigentes (<i>Evergreen repo</i>), en los cuales las Entidades podrán pactar libremente el plazo y establecer que dichas operaciones se prorrogarán de manera automática, de forma tal que siempre mantengan el mismo plazo pactado al inicio de la operación, pudiendo cualquiera de las partes dar aviso a la otra parte con la anticipación y en los términos establecidos en el contrato respectivo, de su intención de vencer anticipadamente o de no continuar prorrogando el referido Reporto.
Fecha probable de amortización anticipada pactada.	Se refiere a las fechas acordadas por las partes, en las cuales es posible amortizar anticipadamente los reportos con modalidad <i>Evergreen</i> .
Forward Starting Repo	Reportos con inicio diferido en los que la transferencia de los Valores o Certificados de Depósito y los fondos objeto de Reporto se efectúe en una fecha posterior al cuarto Día Hábil Bancario inmediato siguiente al que se pactó la operación.
Haircut	Factores de ajuste a los que se refiere el tercer párrafo del numeral 8 de las reglas de reportos, que deberán considerar la aplicación de la metodología que, para tales efectos, acuerden la Asociación de Bancos de México, A.C., y la Asociación Mexicana de Instituciones Bursátiles, A.C., cumpliendo con los lineamientos mínimos descritos en los incisos i) a iv) del mencionado numeral.

Concepto	Descripción
Open Repo	Reportos conocidos como reportos abiertos en los que no se establece un plazo de vencimiento determinado, pudiendo ser vencidos por cualquiera de las partes en cualquier Día Hábil Bancario, previo aviso que se entregue a la otra parte con la anticipación y en los términos pactados en el contrato respectivo.
Periodo de pago del premio	Periodo de tiempo, expresado en días naturales, calculado como la diferencia entre las fechas de pago del premio de la operación de reporto.
Reporto con agente tripartito	Operación de reporto en la que el reportador y el reportado contratan los servicios de un agente tripartito, como los señalados en el numeral 2.8 de las reglas de Reportos.
Reporto con sustitución de valores	Operación de reporto en la cual se permite la sustitución de valores objeto de reporto durante la vigencia de la misma.
Sobretasa	Puntos base que se agregan a la tasa de referencia para determinar la tasa premio de la operación de reporto.
Tasa premio variable	Tasa premio del reporto, cuyo valor se determina periódicamente, como el valor de la tasa de referencia de la tasa premio del periodo, más el valor de la sobretasa.
Tasa de Referencia de la tasa premio	Tasa de interés utilizada como tasa de referencia en los mercados nacionales, e internacionales, cuyo valor varía periódicamente y es utilizado para determinar el premio en la operación de reporto.
Vencimiento anticipado	Evento en el cual se anticipa la fecha de vencimiento de una operación de reporto, previo acuerdo de las partes.

Calendario de entrega de información

Tipo de información	Diaria
Días que se reporta	Día hábil bancario inmediato siguiente al día que corresponda la información.
Horario	Antes de las 9:00 A.M. del día hábil bancario inmediato siguiente al día que corresponda la información.
Nota	La sección III se transmitirá cuando exista canasta de colaterales o sustitución de valores; la sección IV, cuando se presente un vencimiento anticipado de operaciones de reporto o se informe el calendario de fechas específicas de terminación para los reportos <i>Evergreen</i> ; y la sección V, cuando cambie la tasa premio de una operación informada originalmente como Reporto con tasa premio fija.
Sistema informático	SAIF-WEB

Transmisiones fuera de tiempo

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

Retransmisiones

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

Bloque: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo se van a incorporar a la base de datos en "bloque" (Esta opción aplica para todas las secciones del formulario).

Entidades que deberán reportar

Este formulario aplica para las instituciones de crédito, casas de bolsa e instituciones de tecnología financiera (ITF).

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

La institución deberá enviar un registro en las secciones I y II por cada reporto (incluyendo aquellas con importe menor a mil pesos), no agrupando operaciones, aun cuando coincidan las características de las mismas. Lo anterior, excepto en el caso de las ITF que realicen gestiones respecto a sus operaciones de reporto por cuenta de clientes de manera agrupada, las cuales podrán agregarse cuando coincidan en plazo, valor objeto del reporto y cliente (personas físicas o personas morales).

En caso de que la operación considere más de un valor objeto del reporto (reporto con canasta de colaterales), se deberá enviar en la sección III (Valores Objeto del Reporto) un registro por cada clave del valor que conforme la mencionada canasta. Por otra parte, las operaciones celebradas internamente entre áreas, por ejemplo, entre la Tesorería y la Mesa de Dinero de la institución, no deberán ser informadas, ya que estas operaciones no modifican la posición de riesgo ni la tenencia de valores de la institución. Las preguntas que se hacen sobre ciertas características de las operaciones, las diversas instrucciones de llenado del formulario, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo deben considerarse como parte de la normatividad o como una interpretación a esta o como un consentimiento o convalidación o autorización de la autoridad para realizar tales operaciones o para realizarlas en términos y condiciones que no se ajusten a las disposiciones aplicables.

Descripción metodológica

Metodología

El proceso de acopio de información relativa a operaciones de reporto se divide en 5 secciones que a continuación se describen:

Sección 1

En esta sección deben reportarse todas las operaciones de reporto con valores, depositados en el INDEVAL, así como con certificados de depósito emitidos por almacenes generales de depósito, denominados en moneda nacional o Udis.

Se deberá reportar conforme a la ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS.

Sección 2

En esta sección deben reportarse todas las operaciones de reporto con valores y certificados de depósito emitidos por almacenes generales de depósito, denominados en moneda extranjera, depositados en cualquier Depositario de Valores establecido en México o en el extranjero.

Se deberá reportar conforme a la ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.

Sección 3

Esta sección deberá utilizarse para informar los casos en los que la operación de reporto informada en las secciones I o II contemple más de una clave de valor (canasta) ligada al importe operado. Asimismo, deberá ser utilizada para reportar los casos en que se sustituya el valor objeto del reporto informado originalmente en las secciones I o II (sustitución de valores).

Se deberá reportar conforme a la ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VALORES OBJETO DEL REPORTO (CANASTA DE COLATERALES Y SUSTITUCIÓN DE VALORES).

Sección 4

En esta sección deberán informarse los vencimientos anticipados que se presenten en las operaciones de Reporto previamente informadas en las secciones I y II.

Adicionalmente, en esta sección deberá informarse el calendario de fechas probables de amortización anticipada pactada en un reporto con modalidad *Evergreen*.

Se deberá reportar conforme a la ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VENCIMIENTOS ANTICIPADOS.

Sección 5

En esta sección deberán informarse las modificaciones en la tasa premio de las operaciones de reporto pactadas con tipo de tasa premio fija, informadas previamente en las secciones I y II.

Se deberá reportar conforme a la ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A MODIFICACIONES DE LA TASA PREMIO.

Metodología 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.



Especificaciones

A continuación, se presentan las estructuras de datos con su descripción.

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS

Id	Campo	Tipo de dato	Longitud	Decimales	Catálogo	Descripción
1	Institución	Carácter	6	0	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al “Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)”.
2	Fecha de Concertación	Fecha				Fecha en que se concertó la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación	Númérico	5	2		Hora en que se concertó la operación de Reporto.
4	Posición en la Operación	Carácter	1	0	Catálogo de Posiciones en reportos	Posición de la Institución en la operación (conforme al “Catálogo de Posiciones en reportos”).
5	Fecha de Inicio	Fecha				Fecha en que inicia la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento	Fecha				Fecha de vencimiento de la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Reporto	Númérico	12	0		Importe de la operación de Reporto (en miles de pesos).
8	Moneda del Precio Unitario	Carácter	3		Catálogo ISO de Monedas	Moneda del Precio Unitario de los Valores (clave conforme al “Catálogo ISO de Monedas”).
9	Tasa Premio	Númérico	8	4		Tasa de rendimiento pactada como premio de la operación de Reporto (anualizada y en puntos porcentuales).
10	Valor Objeto del Reporto	Carácter	18	0	Catálogo de Valores denominados en MN o UDIS	Clave del valor objeto de la operación de Reporto (clave conforme al “Catálogo de Valores denominados en MN o UDIS”).
11	Precio Unitario de los Valores	Númérico	19	8		Precio unitario al que se negociaron los valores objeto del Reporto (en pesos).
12	Número de Títulos Objeto del Reporto	Númérico	12	0		Número de Títulos negociados en la operación de Reporto.
13	Contraparte del Reporto	Carácter	6	0	Catálogo de Contrapartes	Contraparte con la que se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al “Catálogo de Contrapartes”).
14	Residencia de la Contraparte Persona Física del Extranjero	Carácter	3	0	Catálogo de países	Clave del país de residencia de la contraparte persona física residente en el exterior con la que se concertó la operación. Solo aplica para Contrapartes Físicas del Extranjero. (Clave conforme al “Catálogo de países”).
15	Reporto realizado por cuenta propia o terceros	Carácter	1	0		Clave que identifica Si el reporto fue realizado por cuenta propia o por cuenta de terceros (P = Si es propia T = si es de terceros).
16	Cliente	Carácter	6	0	Clave conforme al “Catálogo Clientes”	Clave del cliente del cual provienen los recursos con los que se realizó la operación de Reporto (000820 = Persona física o 000830 = Persona moral).
17	Corro electrónico	Númérico	2	0	Catálogo de Corros Electrónicos	Clave de la “Casa de Corretaje” (Corro electrónico) por medio de la cual se concertó la operación de Reporto (clave conforme al “Catálogo de Corros Electrónicos”).

Uso Público

Información de acceso público.

18	Tipo de postura	Carácter	2	0	Catálogo de Tipos Postura	Clave de la Postura de la institución en la operación concertada a través de una “Casa de Corretaje” (clave conforme al “Catálogo de Tipos de Postura”).
19	Operación realizada como Banco de Trabajo	Carácter	1	0	Catálogo de Claves de banco de trabajo	Operación realizada como banco de trabajo (clave conforme al “Catálogo de Claves de banco de trabajo”).
20	Haircut o descuento	Numérico	1	2		Porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado del valor objeto del reporto (un entero y dos decimales).
21	Reporto con sustitución de valores	Carácter	1	0		Clave que identifica si la operación presentará una sustitución de valores (S = Sí contempla sustitución de valores o N = No contempla sustitución de valores).
22	Modalidad del reporto	Carácter	2	0		Clave que identifica la modalidad de la operación (OR = Si se trata de un <i>Open Repo</i> , ER = Si se trata de un <i>Evergreen Repo</i> y SM = Si se trata de un reporto sin modalidad especial).
23	Plazo <i>Evergreen</i>	Numérico	3	0		Plazo mínimo de terminación de la operación, que garantiza que el reporto permanezca vigente durante el plazo previamente acordado.
24	Reporto con un conjunto de valores objeto del reporto	Carácter	1	0		Clave que identifica si la operación comprende un conjunto de valores objeto del reporto (canasta) (S = Sí se trata de un reporto con un conjunto de valores objeto de la operación o N = No se trata de un reporto con un conjunto de valores objeto de la operación).
25	Operación con servicio de Agente Tripartito	Carácter	1	0		Clave que identifica si en la operación la institución contrató servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, como los señalados en el numeral 2.8 de las Reglas de Reportos (S = Sí se contrataron los servicios o N = No se contrataron los servicios).
26	Agente Tripartito	Carácter	6	0	Catálogo de Contrapartes	Clave de la entidad contratada por la institución para llevar a cabo los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, como los señalados en el numeral 2.8 de las reglas de Reportos (clave conforme al “Catálogo de Contrapartes”).
27	Tasa de Referencia de la Tasa Premio	Numérico	3	0	Catálogo de Tasas de Referencia	Clave de la tasa de referencia a la cual está referenciada la determinación de la tasa premio de la operación (conforme al “Catálogo de Tasas de Referencia”).
28	Sobretasa para determinar la Tasa Premio	Numérico	8	4		Puntos base que se agregan a la tasa de referencia para determinar la tasa premio de la operación.
29	Periodo de pago del premio de la operación	Numérico	6	0		Diferencia, expresada en días naturales, entre las fechas de pago de premio.
30	Número de identificación de la Operación	Carácter	37	0		Número de Identificación de la operación de Reporto.

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTE DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA

Id	Campo	Tipo de dato	Longitud	Decimales	Catálogo	Descripción
1	Institución	Carácter	6	0	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al “Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)”.
2	Fecha de Concertación	Fecha				Fecha en que se concertó la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación	Númérico	5	2		Hora en que se concertó la operación de Reporto.
4	Posición en la Operación	Carácter	1	0	Catálogo de Posiciones en reportos	Posición de la Institución en la operación (conforme al “Catálogo de Posiciones en reportos”).
5	Fecha de Inicio	Fecha				Fecha en que inicia la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento	Fecha				Fecha de vencimiento de la operación de Reporto (formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Reporto	Númérico	12	0		Importe de la operación de Reporto (en miles de dólares de los EE.UU.A.).
8	Moneda del Precio Unitario	Carácter	3		Catálogo ISO de Monedas	Moneda del Precio Unitario de los Valores (clave conforme al “Catálogo ISO de Monedas”).
9	Tasa Premio	Númérico	8	4		Tasa de rendimiento pactada como premio de la operación de Reporto (anualizada y en puntos porcentuales).
10	Valor Objeto del Reporto	Carácter	18	0	Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera	Clave del valor objeto de la operación de Reporto (clave conforme al “Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera”).
11	Precio Unitario de los Valores	Númérico	19	8		Precio unitario al que se negociaron los valores objeto del Reporto (en dólares de EE.UU.A.).
12	Número de Títulos Objeto del Reporto	Númérico	12	0		Número de Títulos negociados en la operación de Reporto.
13	Contraparte del Reporto	Carácter	6	0	Catálogo de Contrapartes	Contraparte con la que se concertó la operación de Reporto (Clave conforme al “Catálogo de Contrapartes”).
14	Residencia de la Contraparte Persona Física del Extranjero	Carácter	3	0	Catálogo de países	Clave del país de residencia de la contraparte persona física residente en el exterior con la que se concertó la operación. Solo aplica para Contrapartes Físicas del Extranjero. (Clave conforme al “Catálogo de países”).
15	Reporto realizado por cuenta propia o terceros	Carácter	1	0		Clave que identifica si el reporto fue realizado por cuenta propia o por cuenta de terceros (P = Si es propia T = si es de terceros).
16	Cliente	Carácter	6	0	Clave conforme al “Catálogo de Clientes”	Clave del cliente del cual provienen los recursos con los que se realizó la operación de Reporto (000820 = Persona física o 000830 = Persona moral).
17	Corro electrónico	Númérico	2	0	Catálogo de Corros Electrónicos	Clave de la “Casa de Corretaje” (Corro electrónico) por medio de la cual se concertó la operación de Reporto (clave conforme al “Catálogo de Corros Electrónicos”).
18	Tipo de postura	Carácter	2	0	Catálogo de Tipos de Postura	Clave de la Postura de la institución en la operación concertada a través de

Uso Público

Información de acceso público.

						una “Casa de Corretaje” (clave conforme al “Catálogo de Tipos de Postura”).
19	Operación realizada como Banco de Trabajo	Carácter	1	0	Catálogo de Claves de banco de trabajo	Operación realizada como banco de trabajo (clave conforme al “Catálogo de Claves de banco de trabajo”).
20	Haircut o descuento	Numérico	1	2		Porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado del valor objeto del reporto (un entero y dos decimales).
21	Reporto con sustitución de valores	Carácter	1	0		Clave que identifica si la operación presentará una sustitución de valores (S = Sí contempla sustitución de valores o N = No contempla sustitución de valores).
22	Modalidad del reporto	Carácter	2	0		Clave que identifica la modalidad de la operación (OR = Si se trata de un <i>Open Repo</i> , ER = Si se trata de un <i>Evergreen Repo</i> y SM = Si se trata de un reporto sin modalidad especial).
23	Plazo <i>Evergreen</i>	Numérico	3	0		Plazo mínimo de terminación de la operación, que garantiza que el reporto permanezca vigente durante el plazo previamente acordado.
24	Reporto con un conjunto de valores objeto del reporto	Carácter	1	0		Clave que identifica si la operación comprende un conjunto de valores objeto del reporto (canasta) (S = Sí se trata de un reporto con un conjunto de valores objeto de la operación o N = No se trata de un reporto con un conjunto de valores objeto de la operación).
25	Operación con servicio de Agente Tripartito	Carácter	1	0		Clave que identifica si en la operación la institución contrató servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, como los señalados en el numeral 2.8 de las Reglas de Reportos (S = Sí se contrataron los servicios o N = No se contrataron los servicios).
26	Agente Tripartito	Carácter	6	0	Catálogo de Contrapartes	Clave de la entidad contratada por la institución para llevar a cabo los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, como los señalados en el numeral 2.8 de las reglas de Reportos (clave conforme al “Catálogo de Contrapartes”).
27	Tasa de Referencia de la Tasa Premio	Numérico	3	0	Catálogo de Tasas de Referencia	Clave de la tasa de referencia a la cual está referenciada la determinación de la tasa premio de la operación (conforme al “Catálogo de Tasas de Referencia”).
28	Sobretasa para determinar la Tasa Premio	Numérico	8	4		Puntos base que se agregan a la tasa de referencia para determinar la tasa premio de la operación.
29	Periodo de pago del premio de la operación	Numérico	6	0		Diferencia, expresada en días naturales, entre las fechas de pago de premio.
30	Número de identificación de la Operación	Carácter	37	0		Número de Identificación de la operación de Reporto.

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VALORES OBJETO DEL REPORTO (CANASTA DE COLATERALES Y SUSTITUCIÓN DE VALORES).

Id	Campo	Tipo de dato	Longitud	Decimales	Catálogo	Descripción
1	Fecha de transmisión	Fecha				Fecha de transmisión de esta sección. (Formato AAAA/MM/DD).
2	Institución	Carácter	6	0	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al “Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)”.
3	Fecha de Concertación	Fecha				Fecha en que se concertó la operación de Reporto transmitida en las secciones I o II (Formato AAAA/MM/DD).
4	Valor Objeto del Reporto	Carácter	18	0		Clave del valor que conforma la canasta de valores objeto de la operación, o que está sustituyendo la clave informada en las secciones I o II.
5	Precio Unitario de los valores	Numérico	19	8		Precio unitario al que se negociaron los valores con la clave informada en el campo “Valor Objeto del Reporto” (en pesos o en dólares de EE.UU.A., dependiendo de la sección en la que se informó la operación).
6	Número de Títulos Objeto del Reporto	Numérico	12	0		Número de títulos con la clave del valor informada en el campo “Valor Objeto del Reporto”, negociados en la operación de Reporto.
7	Importe	Numérico	12	0		Importe correspondiente a la clave del valor informado en el campo “Valor Objeto del Reporto” (en miles de pesos o en miles de dólares de los EE.UU.A., dependiendo de la sección en la que se informó la operación).
8	Haircut o descuento	Numérico	1	2		Porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado de la clave del valor objeto del reporto informado en el campo “Valor Objeto del Reporto”.
9	Fecha final del colateral	Fecha				Fecha hasta la cual el valor, informado en el campo “Valor Objeto del Reporto”, estará colateralizando la operación. (Formato AAAA/MM/DD).
10	Número de Identificación de la operación	Carácter	37	0		Número de Identificación de la operación de Reporto informada en las secciones I o II.
11	Número de Identificación de la sección Valores Objeto del Reporto	Carácter	37	0		Número de Identificación correspondiente al registro.
12	Sección	Carácter	1	0		Sección en la que se transmitió la operación objeto de este registro (“1” para registros en moneda nacional o Udis o “2” para los registros en moneda extranjera).

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A VENCIMIENTOS ANTICIPADOS

Id	Campo	Tipo de dato	Longitud	Decimales	Catálogo	Descripción
1	Institución	Carácter	6	0	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).
2	Fecha de Concertación	Fecha				Fecha en que se concertó la operación de Reporto transmitida en las secciones I o II (Formato AAAA/MM/DD).
3	Fecha de vencimiento anticipada o de probable amortización anticipada pactada	Fecha				Fecha en que vence anticipadamente la operación de Reporto o de probable terminación anticipada pactada en los reportos con modalidad <i>Evergreen</i> (Formato AAAA/MM/DD).
4	Motivo del Vencimiento o Cancelación Anticipada	Carácter	1	0	Catálogo de Motivos del vencimiento o cancelación anticipada	Motivo del Vencimiento o Cancelación Anticipada del Reporto (clave conforme al “Catálogo de Motivos del vencimiento o cancelación anticipada”) (Valores del catálogo).
5	Número de identificación de la Operación de Reporto	Carácter	37	0		Número de Identificación de la operación de Reporto informada en las secciones I o II.
6	Número de identificación del Vencimiento Anticipado	Carácter	37	0		Número de Identificación correspondiente al registro.
7	Sección	Carácter	1	0		Sección en la que se transmitió la operación objeto de este registro (“1” para registros en moneda nacional o Udis o “2” para los registros en moneda extranjera).

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN RELATIVA A LA MODIFICACIÓN DE LA TASA PREMIO

Id	Campo	Tipo de dato	Longitud	Decimales	Catálogo	Descripción
1	Fecha de transmisión	Fecha				Fecha de transmisión de esta sección. (Formato AAAA/MM/DD).
2	Institución	Carácter	6	0	Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM)	Clave de la Institución que reporta la información, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM).
3	Fecha de Concertación	Fecha				Fecha en que se concertó la operación de Reporto transmitida en las secciones I o II (Formato AAAA/MM/DD).
4	Tasa Premio Modificada	Numérico	8	4		Nueva tasa de rendimiento pactada como premio en la operación de Reporto (anualizada y en puntos porcentuales).
5	Número de identificación de la Operación de Reporto	Carácter	37	0		Número de Identificación de la Modificación del tipo de tasa premio de Reporto informado en las secciones I o II.

6	Número de identificación de la Modificación del Tipo de Tasa	Carácter	37	0	Número de Identificación de la operación de Reporto.
7	Sección	Carácter	1	0	Sección en la que se transmitió la operación objeto de este registro ("1" para registros en moneda nacional o Udis o "2" para los registros en moneda extranjera).

Ayudas específicas para los campos de cada sección

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA NACIONAL O UDIS.

En esta sección se deben reportar las operaciones de reporto con valores cuya moneda de emisión sea pesos o Udis.

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

1. INSTITUCIÓN.

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

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

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

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

3. HORA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTO.

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

4. POSICIÓN DE LA INSTITUCIÓN EN LA OPERACION.

Se deberá anotar: "A" Cuando la institución actúe como reportadora. "P" Cuando la institución actúe como reportada.

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

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

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

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

7. IMPORTE DEL REPORTO (Redondeado a miles sin decimales).

Se deberá anotar el importe del reporto, sin incluir el premio. Este importe deberá expresarse en miles de pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la liquidación de la operación. En su caso, para expresar en pesos el importe de la operación deberá procederse conforme se establece en los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

En el caso de reportos que contemplen un conjunto de valores objeto del reporto (canasta), se debe reportar el importe total que incluya la suma de los importes de todas las claves de valores objeto del reporto.

8. MONEDA EN LA QUE SE CONCERTÓ LA LIQUIDACIÓN DEL REPORTO.

Se deberá anotar la clave de la moneda de liquidación de la operación, conforme al “Catálogo ISO de Monedas”. Por ejemplo, si compran o venden en Reporto Udibonos y la operación se liquida en pesos, en este campo se deberá reportar MXN, es decir, en este campo no deberá indicarse UDIS, ya que se refiere a la moneda de liquidación.

9. TASA PREMIO DEL REPORTO (En Puntos Porcentuales).

Se deberá anotar la tasa de rendimiento pactada como premio por realizar la operación de reporto (anualizada, con enteros y cuatro decimales). En el caso de reportos con tasa variable deberá indicarse la primera tasa que se pagará.

10. CLAVE DEL VALOR OBJETO DEL REPORTO.

Clave de los valores objeto del reporto, conforme al “Catálogo de valores de deuda denominados en Moneda Nacional o UDIS”. En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar la clave del valor.

11. PRECIO UNITARIO A QUE SE NEGOCIARON LOS VALORES OBJETO DEL REPORTO (en unidades y ocho decimales).

Se deberá anotar el "Precio Sucio" unitario al que se concertó el reporto, expresado en pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación. En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el precio por cada clave objeto del reporto.

12. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DEL REPORTO.

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

En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el número de títulos por cada clave objeto del reporto.

13. CONTRAPARTE DEL REPORTO.

Se deberá anotar la clave asignada a la contraparte de que se trate conforme al "Catálogo de Contrapartes". Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito, ii) casas

de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) Financiera Rural v) sociedades de inversión, vi) instituciones de seguros, vii) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, viii) organismos descentralizados del Gobierno Federal, ix) sociedades financieras de objeto múltiple, entidades reguladas, x) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas, y xi) entidades financieras del exterior, deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado “Catálogo de Contrapartes”.

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deberán identificarse con la clave genérica que les corresponda (de la “000760” a la “000860”, excepto la 000840), según el citado “Catálogo de Contrapartes”.

14. RESIDENCIA DE LA CONTRAPARTE (Personas Físicas del Extranjero).

Se deberá anotar la clave del país de residencia de la contraparte con la que se concertó la operación, conforme al “Catálogo de países”, siempre y cuando ésta corresponda a Persona Física Residente en el Exterior, es decir, cuando en el campo “Contraparte del Reporto” se registre la clave 000850. Para contrapartes distintas a la señalada anteriormente, el campo deberá reportarse vacío.

15. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO REALIZADO POR CUENTA PROPIA O DE TERCEROS.

Se deberá indicar con una “P” si el reporto fue realizado por cuenta propia, o con una “T” si es de terceros.

16. CLIENTE

Se deberá anotar, según sea el caso, la clave del cliente del cual provienen los recursos con los que se realizó la operación de Reporto.

Las Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa deberán reportar este campo vacío.

17. "CORRO ELECTRÓNICO".

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

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

18. TIPO DE POSTURA.

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

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

19. OPERACIÓN REALIZADA COMO "BANCO DE TRABAJO".

Se deberá anotar:

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

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

20. HAIRCUT O DESCUENTO.

Se deberá anotar el porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado del valor objeto del reporto expresado con un entero y dos decimales. Por ejemplo: para un *haircut* de 20%, el valor que se debe enviar es: "0.20". En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el *haircut* o descuento por cada clave objeto del reporto.

21. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO CON SUSTITUCIÓN DE VALORES.

Se deberá indicar con una "S" si el reporto contempla sustitución de valores objeto del reporto, o con una "N" en caso contrario.

22. IDENTIFICACIÓN DE LA MODALIDAD DE REPORTO.

Se deberá indicar con "FR" si la operación se refiere a un *Forward-Starting Repo*, "OR" si la operación se refiere a un reporto con plazo abierto (*Open Repo*), con "ER" si la operación se refiere a un reporto siempre vigente (*Evergreen Repo*), y con "SM" si no cuenta con una modalidad especial de reporto.

23. PLAZO Evergreen.

Se deberá indicar en días el plazo mínimo de terminación de la operación, previamente acordado por las partes con modalidad *Evergreen*. En los reportos que contemplen una serie de fechas probables de vencimiento pactadas, este campo deberá reportarse en cero y las fechas mencionadas deberán reportarse en la sección IV, utilizando el motivo: "Calendario de Fechas Probables de Amortización Anticipada Pactada".

Cuando la modalidad de la operación de reporto sea distinta de "ER" este campo deberá reportarse vacío.

24. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO CON UN CONJUNTO DE VALORES OBJETO DEL REPORTO.

Se deberá indicar con una "S" si el reporto contempla un conjunto de valores objeto del reporto (canasta), o con una "N" en caso contrario.

25. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN CON SERVICIO DE AGENTE TRIPARTITO.

Se deberá indicar con una “S” si en el reporte la institución contrató los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, de un Agente Tripartito, o con una “N” en caso contrario.

26. AGENTE TRIPARTITO.

Se deberá anotar la clave de la entidad contratada por la institución para llevar a cabo los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM) o Catálogo General de Contrapartes. En caso de que el campo “Identificación de operación con servicio de Agente Tripartito” se reporte con una “N” este campo se reportará vacío.

27. TASA DE REFERENCIA DE LA TASA PREMIO.

Se deberá anotar la clave de la tasa de referencia que se utilizará para determinar el premio de la operación, conforme al “Catálogo de Tasas de Referencia”. En las operaciones pactadas con tasa premio “fija” se deberá anotar la clave “999” del mencionado catálogo.

28. SOBRETASA PARA DETERMINAR LA TASA PREMIO.

Se deberá informar en enteros y decimales, los puntos que se agregarán a la tasa de referencia para determinar la tasa premio de la operación. Cuando la tasa premio de la operación sea fija este campo deberá reportarse vacío.

29. PERIODO DE PAGO DEL PREMIO DE LA OPERACIÓN.

Se deberá reportar la frecuencia en días con la que se pagará el importe del premio del reporte. En los casos en que el pago se realice por única ocasión y al vencimiento de la operación, se deberá llenar con 0 (cero).

30. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

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

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A OPERACIONES DE REPORTO DE VALORES, DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.

En esta sección se deben reportar las operaciones de reporte con valores cuya moneda de emisión sea moneda extranjera, distinta de pesos o Udis.

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

1. INSTITUCIÓN.

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

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

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

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

3. HORA DE CONCERTACIÓN DEL REPORTO.

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

4. POSICIÓN DE LA INSTITUCIÓN EN LA OPERACION.

Se deberá anotar: "A" Cuando la institución actúe como reportadora. "P" Cuando la institución actúe como reportada.

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

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

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

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

7. IMPORTE DEL REPORTO (redondeado a miles sin decimales).

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

En el caso de reportos que contemplen un conjunto de valores objeto del reporto (canasta), se debe reportar el importe total que incluya la suma de los importes de todas las claves de valores objeto del reporto.

8. MONEDA EN LA QUE SE CONCERTÓ LA LIQUIDACIÓN DEL REPORTO.

Se deberá anotar la clave de la moneda de liquidación de la operación, conforme al “Catálogo ISO de Monedas”. Por ejemplo, si se compran o venden en Reporto Eurobonos emitidos en USD y la operación se liquida en libras esterlinas, en este campo se deberá reportar GBP.

9. TASA PREMIO DEL REPORTO (En Puntos Porcentuales).

Se deberá anotar la tasa de rendimiento pactada como premio por realizar la operación de reporto (anualizada, con enteros y cuatro decimales). En el caso de reportos con tasa variable deberá indicarse la primera tasa que se pagará.

10. CLAVE DEL VALOR OBJETO DEL REPORTO.

Clave de los valores objeto del reporto, conforme al “Catálogo de valores de deuda” denominados en Moneda Nacional o UDIS”. En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar la clave del valor.

Clave de los valores objeto del reporto, conforme al “Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera”. Cuando no exista en dicho catálogo la clave del título objeto de la operación, la Institución deberá transmitir a través del sistema SaifWeb las características del título utilizando el paquete Títulos ME. En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar la clave del valor.

11. PRECIO UNITARIO A QUE SE NEGOCIARON LOS VALORES OBJETO DEL REPORTO (en unidades y ocho decimales).

Se deberá anotar el "Precio Sucio" unitario al que se concertó la operación de reporto, expresado en dólares de los EE.UU.A., independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación. En el caso de operaciones concertadas en divisas distintas a dólares de los EE.UU.A., deberá convertirse el precio unitario a dólares de los EE.UU.A.; para realizar dicha conversión se considerará la cotización que rija para la moneda correspondiente en relación al mencionado dólar en los mercados internacionales, conforme lo establece Banco de México en la regulación aplicable. En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el precio por cada clave objeto del reporto.

12. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DEL REPORTO.

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

En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el número de títulos por cada clave objeto del reporto.

13. CONTRAPARTE DEL REPORTO.

Se deberá anotar la clave asignada a la contraparte de que se trate conforme al "Catálogo de Contrapartes". Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito, ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) Financiera Rural

v) sociedades de inversión, vi) instituciones de seguros, vii) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, viii) organismos descentralizados del Gobierno Federal, ix) sociedades financieras de objeto múltiple, entidades reguladas, x) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas, y xi) entidades financieras del exterior, deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado “Catálogo de Contrapartes”.

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deberán identificarse con la clave genérica que les corresponda (de la “000760” a la “000860”, excepto la 000840), según el citado “Catálogo de Contrapartes”.

14. RESIDENCIA DE LA CONTRAPARTE (Personas Físicas del Extranjero).

Se deberá anotar la clave del país de residencia de la contraparte con la que se concertó la operación, conforme al “Catálogo de países”, siempre y cuando ésta corresponda a Persona Física Residente en el Exterior, es decir, cuando en el campo “Contraparte del Reporto” se registre la clave 000850. Para contrapartes distintas a la señalada anteriormente, el campo deberá reportarse vacío.

15. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO REALIZADO POR CUENTA PROPIA O DE TERCEROS.

Se deberá indicar con una “P” si el reporto fue realizado por cuenta propia, o con una “T” si es de terceros.

16. CLIENTE

Se deberá anotar, según sea el caso, la clave del cliente del cual provienen los recursos con los que se realizó la operación de Reporto.

Las Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa deberán reportar este campo vacío.

17. "CORRO ELECTRÓNICO".

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

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

18. TIPO DE POSTURA.

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

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

19. OPERACIÓN REALIZADA COMO "BANCO DE TRABAJO".

Se deberá anotar:

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

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

20. HAIRCUT O DESCUENTO.

Se deberá anotar el porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado del valor objeto del reporto expresado con un entero y dos decimales. Por ejemplo: para un *haircut* de 20%, el valor que se debe enviar es: "0.20". En caso de que el reporto incluya un conjunto de valores (canasta), este campo deberá reportarse vacío y en la sección III se debe reportar el *haircut* o descuento por cada clave objeto del reporto.

21. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO CON SUSTITUCIÓN DE VALORES.

Se deberá indicar con una "S" si el reporto contempla sustitución de valores objeto del reporto, o con una "N" en caso contrario.

22. IDENTIFICACIÓN DE LA MODALIDAD DE REPORTO.

Se deberá indicar con "FR" si la operación se refiere a un *Forward-Starting Repo*, "OR" si la operación se refiere a un reporto con plazo abierto (*Open Repo*), con "ER" si la operación se refiere a un reporto siempre vigente (*Evergreen Repo*), y con "SM" si no cuenta con una modalidad especial de reporto.

23. PLAZO *Evergreen*.

Se deberá indicar en días el plazo mínimo de terminación de la operación, previamente acordado por las partes con modalidad *Evergreen*. En los reportos que contemplen una serie de fechas probables de vencimiento pactadas, este campo deberá reportarse en cero y las fechas mencionadas deberán reportarse en la sección IV, utilizando el motivo: "Calendario de Fechas Probables de Amortización Anticipada Pactada".

Cuando la modalidad de la operación de reporto sea distinta de "ER" este campo deberá reportarse vacío.

24. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN DE REPORTO CON UN CONJUNTO DE VALORES OBJETO DEL REPORTO.

Se deberá indicar con una "S" si el reporto contempla un conjunto de valores objeto del reporto (canasta), o con una "N" en caso contrario.

25. IDENTIFICACIÓN DE OPERACIÓN CON SERVICIO DE AGENTE TRIPARTITO.

Se deberá indicar con una “S” si en el reporte la institución contrató los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, de un Agente Tripartito, o con una “N” en caso contrario.

26. AGENTE TRIPARTITO.

Se deberá anotar la clave de la entidad contratada por la institución para llevar a cabo los servicios relacionados con la custodia y administración de los valores, conforme al Catálogo del Sistema Financiero Mexicano (CASFIM) o Catálogo General de Contrapartes. En caso de que el campo “Identificación de operación con servicio de Agente Tripartito” se reporte con una “N” este campo se reportará vacío.

27. TASA DE REFERENCIA DE LA TASA PREMIO.

Se deberá anotar la clave de la tasa de referencia que se utilizará para determinar el premio de la operación, conforme al “Catálogo de Tasas de Referencia”. En las operaciones pactadas con tasa premio “fija” se deberá anotar la clave 999 del mencionado catálogo.

28. SOBRETASA PARA DETERMINAR LA TASA PREMIO.

Se deberá informar en enteros y decimales, los puntos que se agregarán a la tasa de referencia para determinar la tasa premio de la operación. Cuando la tasa premio de la operación sea fija este campo deberá reportarse vacío.

29. PERIODO DE PAGO DEL PREMIO DE LA OPERACIÓN.

Se deberá reportar la frecuencia en días con la que se pagará el importe del premio del reporte. En los casos en que el pago se realice por única ocasión y al vencimiento de la operación, se deberá llenar con 0 (cero).

30. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

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

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A VALORES OBJETO DEL REPORTO (CANASTA DE COLATERALES Y SUSTITUCIÓN DE VALORES).

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

1. FECHA (Con Formato AAAA/MM/DD).

Se deberá anotar la fecha en que se está transmitiendo el registro en esta sección.

2. INSTITUCIÓN.

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

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

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

4. CLAVE DEL VALOR OBJETO DEL REPORTO.

Se deberá enviar un registro por cada clave que forme el conjunto de valores objeto del reporto, registrando la clave del valor que conforma la canasta, de acuerdo al "Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Nacional o UDIS" para la sección I o al "Catálogo de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera" para la sección II.

En los reportos con sustitución de valores, se deberá informar la clave del valor que reemplazará la clave informada en las secciones I o II, conforme al Catálogo de Títulos de Deuda que corresponda.

5. PRECIO UNITARIO DE LOS VALORES.

Se deberá reportar el "Precio Sucio" unitario al que se concertó el reporto correspondiente a la clave del valor informada en el campo "Valor Objeto del Reporto", deberá estar expresado en pesos (para registros correspondientes a la sección I), o expresado en dólares de EE.UU.A. (para registros correspondientes a la sección II), en ambos casos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la operación.

En el caso de operaciones concertadas en divisas distintas a dólares de EE.UU.A., deberá convertirse el precio unitario a dólares de los EE.UU.A.; para realizar dicha conversión se considerará la cotización que rija para la moneda correspondiente en relación al mencionado dólar en los mercados internacionales, conforme lo establece el Banco de México en la regulación aplicable.

6. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DEL REPORTO.

Se deberá anotar el número de títulos objeto del reporto correspondiente a la clave del valor informada en el campo "Valor Objeto del Reporto", en unidades sin decimales.

7. IMPORTE DEL REPORTO (Redondeado a miles sin decimales).

Se deberá anotar el importe del reporto correspondiente a la clave de valor informada en el campo "Valor Objeto del Reporto", sin incluir el premio. Para los registros informados en la sección I, este importe deberá expresarse en miles de pesos, independientemente de la moneda en la que se haya concertado la liquidación de la operación. En su caso, para expresar en pesos el importe de la operación deberá procederse conforme se establece en los criterios contables emitidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

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

8. HAIRCUT O DESCUENTO.

Se deberá anotar el porcentaje de descuento aplicado al valor de mercado del valor objeto del reporto expresado con un entero y dos decimales. Por ejemplo: para un *haircut* de 20%, el valor que se debe enviar es: "0.20".

9. FECHA FINAL DEL COLATERAL (Con Formato AAAA/MM/DD).

Se deberá anotar la fecha hasta la cual el valor objeto del reporto, informado en el campo "Valor Objeto del Reporto", estará colateralizando la operación. En el caso de reportos con canasta de valores objeto del reporto, se deberá transmitir diariamente los registros (conjunto de valores que forman la canasta de valores), de esta sección durante la vida del reporto.

Para los reportos con sustitución de valores esta fecha deberá coincidir con la fecha de vencimiento del reporto informada en las secciones I y II, según corresponda, considerando que los registros de esta sección solo se transmitirán cuando se presente un evento de sustitución de valores, informado previamente en el campo "Reporto con sustitución de valores" de las secciones I o II.

10. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número con el que se haya identificado a la operación de reporto en su fecha de concertación informado en las secciones I o II, según corresponda.

11. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA SECCIÓN VALORES OBJETO DEL REPORTO.

Se deberá anotar un número para identificar a cada operación, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más operaciones que tengan la misma fecha de transmisión.

12. SECCIÓN.

Se deberá anotar la sección ("1" o "2"), con la cual está ligado el registro informado en esta sección.

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A VENCIMIENTOS ANTICIPADOS.

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

1. INSTITUCIÓN.

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

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

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

3. FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADA O DE PROBABLE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA PACTADA (Con Formato AAAA/MM/DD).

En este campo se podrán informar dos tipos de eventos:

1. Fecha del vencimiento o cancelación anticipada de cualquier operación de reporto (incluidos los "*Open Repo*" y los "*Evergreen Repo*"). En este caso el campo "Motivo del Vencimiento o Cancelación Anticipada", deberá llenarse con cualquiera de los incisos de "A" a "G", del catálogo de motivos de vencimiento anticipado.
2. Fechas calendario para reportos "*Evergreen*". Se deberán informar las fechas específicas probables de vencimiento pactadas entre las partes. En estos casos se deberán enviar tantos registros como fechas acordadas, y se deberá usar el inciso "H" del catálogo de motivos de vencimiento anticipado.

4. MOTIVO DEL VENCIMIENTO O CANCELACIÓN ANTICIPADA (Valores de acuerdo al catálogo).

Se deberá anotar la clave que corresponda al motivo del vencimiento o cancelación anticipada.

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número con el que se haya identificado a la operación de reporto en su fecha de concertación informado en las secciones I o II, según corresponda.

6. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DEL VENCIMIENTO O CANCELACIÓN ANTICIPADA DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número con el que se identifique al vencimiento o cancelación anticipada de la operación de reporto, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más operaciones que tengan la misma fecha.

7. SECCIÓN.

Se deberá anotar la sección ("1" o "2"), con la cual está ligado el registro informado en esta sección.

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LA SECCIÓN RELATIVA A LA MODIFICACIÓN DE LA TASA PREMIO.

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

1. FECHA (Con Formato AAAA/MM/DD).

Se deberá anotar la fecha en que se está transmitiendo el registro en esta sección.

2. INSTITUCIÓN.

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

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

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

4. TASA PREMIO MODIFICADA DEL REPORTO (En Puntos Porcentuales).

Se deberá anotar la nueva tasa de rendimiento que modifica la originalmente pactada como premio de la operación de reporto (anualizada, con enteros y cuatro decimales).

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número con el que se haya identificado a la operación de reporto en su fecha de concertación informado en las secciones I o II, según corresponda.

6. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA MODIFICACIÓN DEL TIPO DE TASA PREMIO DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número con el que se identifique la modificación del tipo de tasa premio de la operación de reporto, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones internamente; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más operaciones que tengan la misma fecha de concertación.

7. SECCIÓN.

Se deberá anotar la sección ("1" o "2"), con la cual está ligado el registro informado en esta sección.

Catálogos

Catálogo de Corros Electrónicos

Clave	Descripción
10	Enlace INT, S.A. de C.V.
20	Euro Brókers México, S.A. de C.V.
36	GFI group México, S.A. de C.V. (con clientes)
37	Tullet Prebon México, S.A. de C.V. (Interbancario)
38	Tullet Prebon México, S.A. de C.V. (con clientes)
40	SIF-Garban Intercapital México, S.A. de C.V.
45	Plataforma SIPO (de SIF-ICAP)
50	Remate Lince, S.A. de C.V.
55	Sistemas VAR, S.A. de C.V.
80	Sin corro electrónico
90	Decimales
91	Market Axess (Bróker Extranjero)
92	UBS Europe SE (Bróker Extranjero)
93	Bloomberg (Bróker Extranjero)
95	Tradition S.A. de C.V. (Interbancario)
96	Tradition S.A. de C.V. (con clientes)
97	Cicada Securities (Bróker Extranjero)

Catálogo de Posiciones en Reportos

Clave	Descripción
A	Reportador
P	Reportado

Catálogo de Claves de Banco de Trabajo

Clave	Descripción
T	La institución actuó como "Banco de Trabajo"
P	La institución no actuó como "Banco de Trabajo"

Catálogo de Tipos de Postura

Clave	Descripción
A	Operación cerrada por la institución (agresor) en postura en firme en el corro
B	Operación cerrada por la institución (agredida) en postura en firme en el corro
C	Operación cerrada por la institución (agresor) en postura tipo cama en el corro
D	Operación cerrada por la institución (agredida) en postura tipo cama en el corro
E	Operación cerrada por la institución (agresor) en postura tipo cama interactiva en el corro
F	Operación cerrada por la institución (agredida) en postura tipo cama interactiva en el corro
G	Operación cerrada por la institución (agresor) en postura tipo ronda en el corro
H	Operación cerrada por la institución (agredida) en postura tipo ronda en el corro

Uso Público

Información de acceso público.

Clave	Descripción
I	Operación cerrada por la institución (agresor) en postura tipo ronda interactiva en el corro
J	Operación cerrada por la institución (agredida) en postura tipo ronda interactiva en el corro
NA	No aplica (la operación se concertó sin utilizar corro)
ND	No disponible
P	Si la operación deriva de una postura presentada por la institución en el corro (agredido)

Catálogo de Motivos Vencimiento Anticipado

Clave	Descripción
A	Incumplimiento en entrega de garantías
B	Por Causa de Rescisión y/o Causa de Terminación Objetiva
C	Por solicitud de la Institución
D	Por solicitud de la Contraparte
E	Incumplimiento del emisor
F	Reporto con plazo abierto (<i>Open Repo</i>)
G	Reporto siempre vigente (<i>Evergreen Repo</i>)
H	Calendario de Fechas Probables de Amortización Anticipada Pactada (solo para <i>Evergreen Repo</i>)

Catálogo de Modalidades Especiales de Reporto

Clave	Descripción
FR	Forward-Starting Repo
OR	Reporto con plazo abierto (<i>Open Repo</i>)
ER	Reporto siempre vigente (<i>Evergreen Repo</i>)
SM	Reporto sin modalidad especial

Catálogo de Tasas de Referencia

Clave	Nombre	Descripción
040	CETES 28	CETES 28 DÍAS
050	CETES 91	CETES 91 DÍAS
052	CETES 182	CETES 182 DÍAS
070	TIIE FONDEO	TIIE DE FONDEO A 1 DÍA
080	TIIE 28	TIIE 28 DÍAS
090	TIIE 91	TIIE 91 DIAS
105	TASA PONDERADA DE FONDEO GUBERNAMENTAL	TASA PONDERADA DE FONDEO GUBERNAMENTAL
107	TASA OBJETIVO	TASA DE INTERÉS INTERBANCARIA A UN DÍA DETERMINADA TASA OBJETIVO PARA EFECTOS DE POLÍTICA MONETARIA
127	TREASURY BILL 1	TREASURY BILL 1 MES
130	TREASURY BILL 3	TREASURY BILL 3 MESES
135	TREASURY BILL 6	TREASURY BILL 6 MESES
155	Max[CETES28, TPGF]	Max[CETES28, TPGF] (TPGF: Tasa Promedio de Fondeo Gubernamental)
165	Max[CETES91, TPGF]	Max[CETES91, TPGF] (TPGF: Tasa Promedio de Fondeo Gubernamental)
210	SOFR	SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE
220	SONIA	STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE
230	TONAR	TOKYO OVERNIGHT AVERAGE RATE
999	SIN TASA REFERENCIA	OPERACIÓN DE REPORTO CON TIPO DE TASA FIJA



BANCO DE MÉXICO®

www.banxico.org.mx