BANCO DE MÉXICO

Formulario ACLME-PDCB

Relativo al Régimen de Posición de Riesgo Cambiario para las Casas de Bolsa

FORMULARIO ACLME-PDCB RELATIVO AL RÉGIMEN DE POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO

Contenido

AYUDAS GENÉRICAS 4
I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN 4
II. OBJETIVO DEL FORMULARIO 4
III. COBERTURA DEL FORMULARIO 4
IV. SECCIONES DEL FORMULARIO 4
V. VALOR DE LAS OPERACIONES 5
VI. DIVERSAS CONSIDERACIONES DEL FORMULARIO 6
VII. PARTES DE LAS OPERACIONES 6
VIII. PLAZO DE LAS OPERACIONES CAMBIARIAS 6
IX. OPERACIONES YA PACTADAS PENDIENTES DE LIQUIDAR (24, 48, 72 Y 96 HORAS). 6
X. OPERACIONES DE FORWARDS, FUTUROS, SWAPS, OPCIONES, REPORTOS Y PRÉSTAMOS. 7
XI. "CLAVE" DE CADA UNA DE LAS CIFRAS DEL FORMULARIO. 7
XII. OPERACIONES QUE NO DEBEN INCLUIRSE 8
XIII. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN. 8
XIV. METODOLOGÍAS DE CONFRONTAS 8
XV. OTRAS CONSIDERACIONES 9
Incrementos de Capital 9
ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES I A IV DEL FORMULARIO ACLME-PDCB 10
ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN V DEL FORMULARIO ACLME-PDCB 10
FORMULARIO ACLME-PDCB INFORMACIÓN RELATIVA AL RÉGIMEN DE POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO 11
AGRUPACIÓN DE LOS CONCEPTOS DEL FORMULARIO ACLME-PDCB, POR EL DETALLE EN EL PLAZO CON QUE DEBEN REPORTARSE 17
VALIDACIONES DEL FORMULARIO ACLME - PDCB 19
VALIDACIONES DE ESTRUCTURA DEL FORMULARIO ACLME-PDCB EN EL SISTEMA DE ACOPIO (SAIF-WEB) 19
Paquete: ACLMECB Secc I-II COMPLEMENTO y ACLMECB Secc III-IV y V 19
Paquete: ACLMECB Secc III-IV 20

Paquete: ACLMECB Secc II 20
Paquete: ACLMECB Secc V 20
POSICIONES NETAS 21
Paquete: ACLMECB Secc III-IV 21
VALIDACIONES DE NEGOCIO DEL FORMULARIO ACLME-PDCB EN EL SISTEMA DE ACOPIO (SAIF-WEB) 22
Paquete: ACLMECB Secc I-II COMPLEMENTO 22
Paquete ACLMECB Secc III-IV y V PREVIO 23
VALIDACIONES DE NEGOCIO DEL FORMULARIO ACLME-PDCB FUERA DEL SISTEMA DE ACOPIO (SAIFWEB) 25
CATÁLOGOS Y ANEXOS 27
CATÁLOGO DE CONTRAPARTES (SECCIÓN V) DEL FORMULARIO ACLME-PDCB DE LAS CASAS DE BOLSA 27
CALENDARIO DE ENTREGA DE INFORMACIÓN DE LAS SECCIONES I Y II, DEL FORMULARIO ACLME-PDCB 28

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."

II. OBJETIVO DEL FORMULARIO

Obtener información que permita: a) dar seguimiento y realizar los cómputos de la posición de riesgo cambiario, y b) la elaboración de diversas estadísticas.

III. COBERTURA DEL FORMULARIO

En el formulario se solicita diversa información relativa a 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, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo deberán considerarse como parte de la normatividad o como una interpretación a ésta o como un consentimiento o autorización o convalidación de la autoridad para realizar tales operaciones o para realizarlas en términos y condiciones que no se ajusten a las disposiciones aplicables.

IV. SECCIONES DEL FORMULARIO

El formulario está compuesto por cinco secciones:

Sección I.- Comprende operaciones activas y pasivas, denominadas en o referidas a moneda extranjera, liquidables en moneda extranjera o en moneda nacional (conceptos 3010 al 9822).

Sección II.- Comprende operaciones de derivados, denominadas en o referidas a moneda extranjera, liquidables en moneda extranjera o en moneda nacional (conceptos 9880 al 9940). Deberán registrarse los Futuros, Forwards u Opciones, según sea el caso, a valor nocional o a valor de mercado, según corresponda, tanto la parte de la operación que genere posición larga como la que genere posición corta.

Sección III.- Comprende información para el cálculo de la posición de riesgo cambiario, (conceptos 10001 a 13301).

Dicha sección está compuesta por 7 subsecciones:

III-A Nuevas operaciones que generan movimientos a la posición de divisas.

III-B Vencimiento de operaciones que generan movimientos a la posición de divisas.

III-C Posición de opciones.

III-D Posición de divisas de las filiales financieras.

III-E Posición neta de divisas, de la casa de bolsa y, en su caso, de la casa de bolsa con sus filiales financieras.

III-F Posición de Swaps.

III-G Posición de divisas, por cada una de las principales monedas.

Sección IV.- Comprende las operaciones cambiarias concertadas el día a que corresponde el reporte (conceptos 13401 al 15301), agrupadas a su plazo por vencer en días naturales.

Dicha sección está compuesta por 2 subsecciones:

IV-A. Operaciones peso-dólar de los EE.UU.A., clasificadas por el sector a que corresponde la contraparte, ya sea operaciones realizadas con entidades mexicanas: instituciones de crédito, casas de cambio, casas de bolsa, otros intermediarios financieros, sector privado y sector público (conceptos 13401 al 14501) o las operaciones realizadas con entidades del extranjero: entidades financieras y entidades no financieras (conceptos 14601 al 14901).

IV-B. Operaciones peso-divisa distinta del dólar de los EE.UU.A. y divisa-divisa, clasificadas por contraparte: instituciones de crédito mexicanas (conceptos 15001 y 15101) y otras contrapartes (conceptos 15201 y 15301).

Sección V.- Comprende las operaciones cambiarias realizadas con instituciones de crédito, casas de cambio mexicanas y otras casas de bolsa mexicanas, concertadas el día a que corresponde el reporte.

Cabe señalar que en esta sección se tendrá que reportar el importe total de las operaciones por cada contraparte: un registro para las operaciones de compra y otro para las de venta.

V. VALOR DE LAS OPERACIONES

Las Operaciones en Moneda Extranjera, deberán reportarse a valor contable, en términos de las disposiciones emitidas por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, netas, en su caso, de las correspondientes reservas o efectos en valuación.

Sin perjuicio de lo anterior, las operaciones de opción, previstas en las disposiciones emitidas por el Banco de México de manera conjunta con la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, computarán por el resultado de multiplicar su monto nocional por la delta que resulte al utilizar el modelo de valuación aplicado por la casa de bolsa para la operación financiera derivada de que se trate.

VI. DIVERSAS CONSIDERACIONES DEL FORMULARIO

La información de este formulario deberá reportarse con cifras en miles de dólares.

Las operaciones denominadas en moneda extranjera distinta al dólar de los EE.UU.A., deberán convertirse a dólares de los EE.UU.A., considerando la cotización que rija para la moneda correspondiente contra el mencionado dólar de los EE.UU.A., en los mercados internacionales, al cierre de las operaciones del día de que se trate.

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

Este formulario no constituye una balanza contable.

VII. PARTES DE LAS OPERACIONES

Para efectos de la vigilancia a que se refiere el presente formulario, algunas operaciones están compuestas por una o más partes. Por ejemplo, la tenencia de títulos sólo tiene una parte activa: los títulos.

Existen ciertas operaciones compuestas por dos o más partes, en donde alguna de tales partes está denominada o referida a moneda nacional. En este formulario sólo deberán incluirse la parte de las operaciones denominadas en o referidas a moneda extranjera.

VIII. PLAZO DE LAS OPERACIONES CAMBIARIAS

Deberá determinarse el "plazo por vencer" en días naturales de cada operación o de cada una de las partes de las operaciones comprendidas en las secciones IV y V. Para ello dicho plazo será equivalente al número de días naturales que se determine considerando que en todos los casos el “plazo a vencimiento” de las operaciones:

A. Inicia el día al que corresponda el reporte, sin importar la fecha de emisión, otorgamiento o contratación, según sea el caso, o el tipo de operación.

B. Termina en la fecha de liquidación de la operación de que se trate.

IX. OPERACIONES YA PACTADAS PENDIENTES DE LIQUIDAR (24, 48, 72 Y 96 HORAS).

En las operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas.) su importe deberá registrarse en el presente formulario desde la fecha en que se haya pactado la operación de que se trate.

X. OPERACIONES DE FORWARDS, FUTUROS, SWAPS, OPCIONES, REPORTOS Y PRÉSTAMOS.

En las operaciones de forwards, futuros, opciones, swaps, reportos y préstamos de valores, su importe deberá registrarse en el presente formulario desde la fecha en que se haya pactado la operación de que se trate.

XI. "CLAVE" DE CADA UNA DE LAS CIFRAS DEL FORMULARIO.

La clave de cada una de las cifras del formulario, se conformará de la siguiente manera.

Secciones I y II:

- Los cuatro primeros dígitos: que estarán referidos al número secuencial de "concepto" al que corresponda la operación, según se detallan en el contenido del FORMULARIO ACLME-PDCB INFORMACIÓN RELATIVA AL RÉGIMEN DE POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO.

Secciones III y IV:

- Los cinco primeros dígitos: que estarán referidos al número secuencial de "concepto" al que corresponda la operación, según se detallan en el contenido del FORMULARIO ACLME-PDCB INFORMACIÓN RELATIVA AL RÉGIMEN DE POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO.

Para las Secciones I-IV los tres siguientes dígitos que estarán referidos al respectivo plazo por vencer de la operación. Al efecto, en la AGRUPACIÓN DE LOS CONCEPTOS DEL FORMULARIO ACLME-PDCB, POR EL DETALLE EN EL PLAZO CON QUE DEBEN REPORTARSE, se señalan los dígitos aplicables a cada concepto.

Dicho plazo por vencer se codificará conforme a lo siguiente:

OPERACIONES QUE DEBEN REGISTRARSE SIN PLAZO (SECCIONES I a III)

000 En aquellos conceptos en los que se indique que deberán registrarse sin plazo.

OPERACIONES CAMBIARIAS QUE DEBEN REGISTRARSE CON PLAZO DE 1, 2, 3 Y HASTA 11 DÍAS NATURALES O MISMO DÍA (SECCIÓN IV)

001 En las operaciones con plazo por vencer de 1 día natural.
002 En las operaciones con plazo por vencer de 2 días naturales.
...
011 En las operaciones con plazo por vencer de 11 días naturales
780 En las operaciones cambiarias que se liquiden el mismo día

XII. OPERACIONES QUE NO DEBEN INCLUIRSE

En este formulario no deberán incluirse las operaciones comprendidas en el Anexo 2 de la Circular 115/2002, salvo que en algún concepto se soliciten específicamente para efectos informativos.

XIII. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN.

Las secciones I y II de este formulario deberán transmitirse a más tardar a las 13 horas, con cifras de cada uno de los días señalados en el Anexo A. **¡Error! No se encuentra el origen de la referencia.**, conforme al plazo de entrega indicado en el mismo.

Las secciones III a V de este formulario deberán transmitirse con cifras de cada día hábil, a más tardar a las 18:00 horas del propio día a que corresponda la información.

El soporte técnico relacionado con el acceso de las personas usuarias, así como la operación del sistema de acopio es de las 9:00 a las 20:30 horas de lunes a viernes en días hábiles bancarios.

Cabe señalar que el SAIFWeb requiere la información organizada en tres archivos:

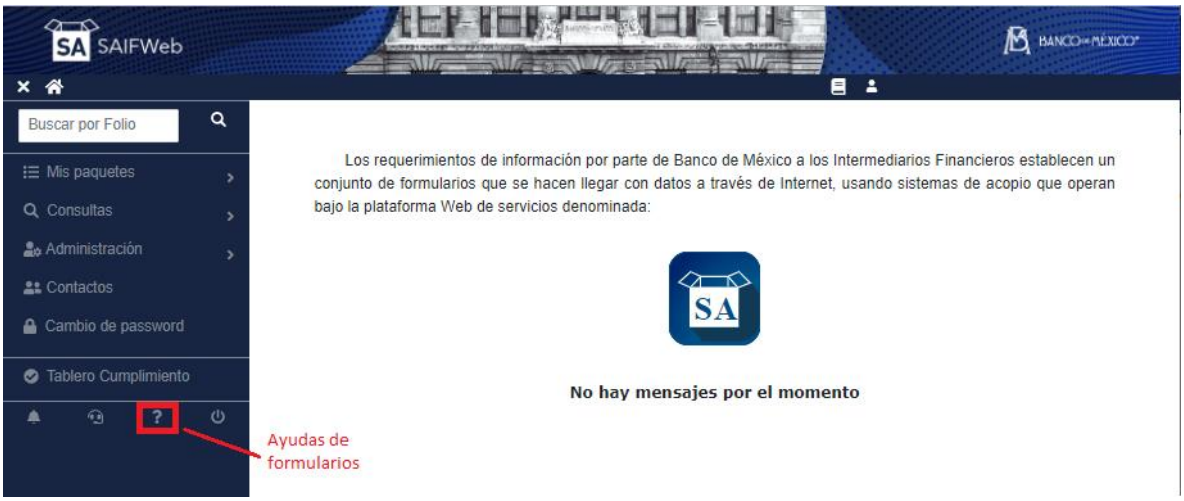
Primero	La información de las secciones III y IV.
Segundo	La información de la sección V.
Tercero	La información de las secciones I y II.

El SAIFWeb también requiere que los archivos primero y segundo se transmitan conjuntamente.

XIV. 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.



XV. OTRAS CONSIDERACIONES

Incrementos de Capital

Las casas de bolsa que hayan incrementado su capital contribuido en el primer o segundo mes inmediato anterior al mes para el que se realiza el correspondiente cálculo; a efecto de proceder conforme a lo dispuesto en los incisos c) o d) del numeral CB.3.2.3 de la Circular 115/2002 deberán:

1. Enviar un escrito a la Dirección de Información del Sistema Financiero, en el que especifique: la o las partidas que originaron el incremento del capital contribuido, así como el importe de éstas; la fecha del incremento, y copia de algún documento mediante el cual se compruebe el mismo incremento.

2. Especificar el importe del Capital Básico relativo a la fecha en que efectivamente se haya realizado el citado incremento.

3. El escrito deberán enviarlo a más tardar el quinto día hábil inmediato anterior al inicio del mes para el cual se pretenda considerar el Capital Básico ya incrementado.

ESTRUCTURA DE LAS SECCIONES I A IV DEL FORMULARIO ACLME-PDCB

	Campo	Tipo	Descripción
1	Clave de Institución	Carácter (6)	Clave de la institución a la que corresponde la información
2	Fecha	Fecha (8)	Fecha a la que corresponde la información
3	Concepto	Numérico (5)	Clave del concepto al cual corresponde la información
4	Plazo	Carácter (3)	Clave del plazo por vencer de la operación
5	Monto	Numérico (11)	Monto de la operación en miles de dólares de los EE. UU. A.

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN V DEL FORMULARIO ACLME-PDCB

	Campo	Tipo	Descripción
1	Clave de institución	Carácter (6)	Clave de la institución a la que corresponde la información
2	Fecha de Concertación	Fecha (8)	Fecha en la que se concertó la operación (Formato AAAA/MM/DD)
3	Clave de la contraparte	Carácter (6)	Clave de la institución con la cual se realiza la operación
4	Tipo de operación	Carácter (1)	Compra o Venta de moneda extranjera
5	Monto	Numérico (11)	Monto de la operación en miles de dólares de los EE. UU. A.
6	Fecha de Entrega o Recepción	Fecha (8)	Fecha en la que se entregará o se recibirá la moneda extranjera (Formato AAAA/MM/DD)

FORMULARIO ACLME-PDCB INFORMACIÓN RELATIVA AL RÉGIMEN DE POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO

Clave

SECCIÓN I.- OPERACIONES ACTIVAS Y PASIVAS DE LA CASA DE BOLSA, DENOMINADAS EN O REFERIDAS A MONEDA EXTRANJERA, LIQUIDABLES EN MONEDA EXTRANJERA O EN MONEDA NACIONAL

A. OPERACIONES ACTIVAS

DISPONIBILIDADES

3010 Billetes y Monedas Extranjeros (Caja)
3022 Depósitos en Entidades Financieras del Exterior
3050 Depósitos en Bancos Mexicanos (Bancos Múltiples y de Desarrollo)
3055 Otras Disponibilidades (distintas, en su caso, a las incluidas en otros renglones de esta sección del formulario)

CARTERA DE VALORES (NETA, EN SU CASO, DE LAS CORRESPONDIENTES ESTIMACIONES)

3090 Valores negociables y para cobrar o vender (de deuda) (concepto actualizado 202201)
3215 Valores para cobrar principal e interés (de deuda) (concepto actualizado 202201)
3220 Acciones y Recibos de Depósito, Bursátiles Emitidos por Empresas Residentes en el Extranjero
3225 Recibos de Depósito, bursátiles, Emitidos por Empresas Residentes en México (dato informativo)

CARTERA DE CRÉDITOS (NETA, EN SU CASO, DE LAS CORRESPONDIENTES ESTIMACIONES)

3382 Créditos Otorgados (Netos de sus respectivas Reservas Preventivas)

OPERACIONES FECHA VALOR

3490 Moneda extranjera a recibir por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas) distintas a Operaciones Cambiarias
3507 Valores a recibir (de deuda) por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas)
3508 Acciones y Recibos de Depósito, bursátiles emitidos por empresas residentes en el extranjero, a recibir por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas)
3509 Recibos de depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en México, a recibir por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas) (dato informativo)

OPERACIONES CAMBIARIAS

3535 Moneda Extranjera a Recibir por Compras 24, 48, 72 y 96 Horas

REPORTOS Y PRÉSTAMOS DE VALORES

4640 Moneda Extranjera a Recibir por Operaciones de Reporto
VALORES A RECIBIR POR OPERACIONES DE REPORTO:
4708 De deuda
4710 Acciones y Recibos de Depósito, bursátiles emitidos por empresas residentes en el extranjero
4715 Recibos de Depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en México (dato informativo)
4720 Moneda Extranjera a Recibir por "Repos" (Financiamiento con Garantía de Valores)
VALORES A RECIBIR POR PRÉSTAMO DE VALORES:
4850 De deuda
4852 Acciones y Recibos de Depósito, Bursátiles Emitidos por Empresas Residentes en el Extranjero
4860 Recibos de Depósito, Bursátiles, Emitidos por Empresas Residentes en México (dato informativo)

OTROS ACTIVOS

4930 Otros Activos (Distintos a los comprendidos en los renglones anteriores y a los señalados en el Anexo 2 de la Circular 115/2002)

Uso Público

Información de acceso público.

B. OPERACIONES PASIVAS

PRÉSTAMOS Y CRÉDITOS RECIBIDOS

6315 Préstamos y Créditos Recibidos de Bancos Múltiples y de Desarrollo (del País)

6345 Préstamos y Créditos de Entidades Financieras del Exterior

OPERACIONES FECHA VALOR

6370 Moneda extranjera a entregar por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas), distintas a Operaciones Cambiarias

6400 Valores a entregar por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas)

6405 Acciones y Recibos de Depósito, bursátiles emitidos por empresas residentes en el extranjero, a entregar por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas)

6410 Recibos de depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en México, a entregar por operaciones ya pactadas pendientes de liquidar (24, 48, 72 y 96 horas) (dato informativo)

OPERACIONES CAMBIARIAS

6435 Moneda Extranjera a Entregar por Ventas 24, 48, 72 y 96 horas

REPORTOS Y PRÉSTAMOS DE VALORES

7010 Moneda Extranjera a entregar por Operaciones de Reporto

VALORES A ENTREGAR POR OPERACIONES DE REPORTO:

7035 De deuda

7040 Acciones y Recibos de Depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en el extranjero

7045 Recibos de Depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en México (dato informativo)

7050 Moneda Extranjera a entregar por "Repos" (Financiamiento con Garantía de valores)

VALORES A ENTREGAR POR PRÉSTAMO DE VALORES:

7100 De deuda

7105 Acciones y Recibos de Depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en el extranjero

7110 Recibos de Depósito, bursátiles, emitidos por empresas residentes en México (dato informativo)

OTROS PASIVOS

7350 Saldos Acreedores de las cuentas de Activo

7355 Otros Pasivos (Distintos a los comprendidos en los renglones anteriores y a los señalados en el Anexo 2 de la Circular 115/2002)

7400 Obligaciones Subordinadas de Conversión Obligatoria, convertibles en acciones de la casa de bolsa (dato informativo)

C. OTROS DATOS

9822 Billetes y Monedas exclusivamente dólares de los EE.UU.A. (dato informativo)

SECCIÓN II.- OPERACIONES DE DERIVADOS DE LA CASA DE BOLSA, DENOMINADAS EN O REFERIDAS A MONEDA EXTRANJERA, LIQUIDABLES EN MONEDA EXTRANJERA O EN MONEDA NACIONAL

DERIVADOS

FUTUROS (EN MERCADOS RECONOCIDOS), CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

9880 Parte de la operación que genera posición larga

9885 Parte de la operación que genera posición corta

FORWARDS, CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

9890 Parte de la operación que genera posición larga

9895 Parte de la operación que genera posición corta

POSICIÓN DE OPCIONES, CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADA EN O REFERIDA A MONEDA EXTRANJERA (APLICANDO AL VALOR DE LAS OPERACIONES, SUBYACENTE Y MONEDA EXTRANJERA DE LIQUIDACIÓN, LA DELTA QUE RESULTE DE APLICAR EL MODELO DE VALUACIÓN UTILIZADO POR LA CASA DE BOLSA)

9930 Parte de la operación que genera Posición Larga (subyacente a valor nocional y moneda extranjera de liquidación a precio pactado)

Uso Público

Información de acceso público.

9940	Parte de la operación que genera Posición Corta (subyacente a valor nocional y moneda extranjera de liquidación a precio pactado)

SECCIÓN III.- INFORMACIÓN PARA EL CÁLCULO DE LA POSICIÓN DE RIESGO CAMBIARIO, RELATIVA AL DÍA DE QUE SE TRATE

A. NUEVAS OPERACIONES QUE GENERAN MOVIMIENTOS A LA POSICIÓN DE DIVISAS

NUEVAS OPERACIONES DE LA CASA DE BOLSA

	CONTRATACIONES DE OPERACIONES CAMBIARIAS (MISMO DÍA, 24, 48, 72 Y 96 HORAS)
10001	Parte de la operación que genera Posición Larga
10051	Parte de la operación que genera Posición Corta
	CONTRATACIONES DE FUTUROS (EN MERCADOS RECONOCIDOS), CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR NOCIONAL)
10101	Parte de la operación que genera posición larga
10151	Parte de la operación que genera posición corta
	CONTRATACIONES DE FORWARDS, CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR NOCIONAL)
10201	Parte de la operación que genera posición larga
10251	Parte de la operación que genera posición corta
	CONTRATACIONES DE SWAPS (A VALOR NOCIONAL)
10301	Parte de la operación que genera posición larga
10351	Parte de la operación que genera posición corta
	OTRAS OPERACIONES DISTINTAS A LAS SEÑALADAS EN LOS CONCEPTOS 10001 A 10351 Y 11201 Y 11301 QUE AFECTAN A LA POSICIÓN DE DIVISAS, Y DISTINTAS A LAS SEÑALADAS EN EL ANEXO 2 DE LA CIRCULAR 115/2002
	OPERACIONES QUE INCREMENTEN LA POSICIÓN LARGA
10401	Cobro en moneda extranjera de las diferencias por operaciones de derivados liquidables por diferencias en moneda extranjera
10416	Variación positiva en el valor de las operaciones en divisas distintas al dólar de los EE.UU.A., respecto del último valor registrado, al convertirlas a dichos dólares
10421	Importe del producto del ejercicio de operaciones de opción con entrega del subyacente: (subyacente y moneda extranjera de liquidación, según aplique)
10451	Cobro de moneda extranjera por intereses, comisiones y servicios
10501	Diferencia positiva entre el precio de venta y el valor contable, por venta de activos en moneda extranjera
10521	Cancelación de Reservas Preventivas de Cartera en moneda extranjera (concepto actualizado 202201)
10551	Otras
	OPERACIONES QUE INCREMENTEN LA POSICIÓN CORTA
10601	Pago en moneda extranjera de las diferencias por operaciones de derivados liquidables por diferencias en moneda extranjera
10616	Variación negativa en el valor de las operaciones en divisas distintas al dólar de los EE.UU.A., respecto del último valor registrado, al convertirlas a dichos dólares
10621	Importe del producto del ejercicio de operaciones de opción con entrega del subyacente: (subyacente y moneda extranjera de liquidación, según aplique)
10651	Pago de moneda extranjera por intereses, comisiones y servicios
10701	Diferencia positiva entre el valor contable y el precio de venta, por venta de activos en moneda extranjera
10721	Creación de Reservas Preventivas de Cartera en moneda extranjera (concepto actualizado 202201)
10751	Otras

B. VENCIMIENTO DE OPERACIONES QUE GENERAN MOVIMIENTOS A LA POSICIÓN DE DIVISAS

OPERACIONES DE DERIVADOS DE LA CASA DE BOLSA, QUE SE LIQUIDARON POR DIFERENCIAS O QUE SE VAN A LIQUIDAR POR DIFERENCIAS (SIN IMPORTAR LA MONEDA DE LIQUIDACIÓN)

FUTUROS (EN MERCADOS RECONOCIDOS), CUYO SUBYACENTE ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

10801 Vencimientos de Compra, subyacente de referencia y vencimientos de venta con moneda extranjera como moneda de liquidación (disminuyen la posición larga)

10851 Vencimientos de Venta, subyacente de referencia y vencimientos de compra con moneda extranjera como moneda de liquidación (disminuyen la posición corta)

FORWARDS, CUYO SUBYACENTE ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

10901 Vencimientos de Compra, subyacente de referencia y vencimientos de venta con moneda extranjera como moneda de liquidación (disminuyen la posición larga)

10951 Vencimientos de Venta, subyacente de referencia y vencimientos de compra con moneda extranjera como moneda de liquidación (disminuyen la posición corta)

SWAPS, CUYO SUBYACENTE ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

11001 Vencimientos de Operaciones que generan una posición larga, (disminuyen la posición larga)

11051 Vencimientos de Operaciones que generan una posición corta, (disminuyen la posición corta)

OPERACIONES PAGADERAS EN MONEDA NACIONAL REFERIDAS A TIPOS DE CAMBIO DE MONEDA NACIONAL CONTRA DIVISAS

11101 Depósitos, Valores y Créditos (Activas, disminuyen la posición larga)

11151 Depósitos y Préstamos (Pasivas, disminuyen la posición corta)

C. POSICIÓN DE OPCIONES

POSICIÓN DE OPCIONES DE LA CASA DE BOLSA, CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADA EN O REFERIDA A MONEDA EXTRANJERA (APLICANDO AL VALOR DE LAS OPERACIONES,

SUBYACENTE Y MONEDA EXTRANJERA DE LIQUIDACIÓN, LA DELTA QUE RESULTE DE APLICAR EL MODELO DE VALUACIÓN UTILIZADO POR LA INSTITUCIÓN)

11201 Parte de la operación que genera Posición Larga (subyacente a valor nocional y moneda extranjera de liquidación a precio pactado)

11301 Parte de la operación que genera Posición Corta (subyacente a valor nocional y moneda extranjera de liquidación a precio pactado)

D. POSICIÓN DE DIVISAS DE LAS FILIALES FINANCIERAS

POSICIÓN DE LAS FILIALES FINANCIERAS EN EL EXTRANJERO (EN PESOS MEXICANOS CONVERTIDOS A MILES DE DÓLARES)

11401 Valor absoluto de la cifra negativa que resulte de restar a los Activos en pesos mexicanos, los Pasivos en pesos mexicanos, de las Filiales Financieras en el extranjero (generan una Posición Larga en moneda extranjera)

11501 Cifra positiva que resulte de restar a los Activos en pesos mexicanos, los Pasivos en pesos mexicanos, de las Filiales Financieras en el extranjero (generan una Posición Corta en moneda extranjera)

POSICIÓN DE LAS FILIALES FINANCIERAS MEXICANAS (EN MONEDA EXTRANJERA)

11601 Posición Neta Larga

11701 Posición Neta Corta

E. POSICIÓN FINAL DE RIESGO CAMBIARIO

POSICIÓN FINAL EN MONEDA EXTRANJERA DE LA CASA DE BOLSA

11801 Posición Final Neta Larga (Cifra positiva que resulta de la siguiente operación: Última posición reportada más movimientos que generan posición larga, menos movimientos que generan posición corta)

11901 Posición Final Neta Corta (Valor absoluto de la cifra negativa que resulta de la siguiente operación: Última posición reportada más movimientos que generan posición larga, menos movimientos que generan posición corta)

POSICIÓN FINAL EN MONEDA EXTRANJERA, DE LA CASA DE BOLSA MÁS, EN SU CASO, FILIALES FINANCIERAS EN MÉXICO Y EN EL EXTERIOR

11951 Posición Final Neta Larga (Cifra positiva que resulta de la siguiente operación: Posición final de la casa de bolsa positiva o negativa (+ / -) la posición final de las filiales financieras en México y en el Exterior)

11971 Posición Final Neta Corta (Valor absoluto de la cifra negativa que resulta de la siguiente operación: Posición final de la casa de bolsa positiva o negativa (+ / -) la posición final de las filiales financieras en México y en el Exterior)

Uso Público

Información de acceso público.

F. POSICIÓN DE SWAPS (DATO INFORMATIVO)

SWAPS, CUYO SUBYACENTE O MONEDA DE LIQUIDACIÓN ESTÉ DENOMINADO EN O REFERIDO A MONEDA EXTRANJERA (A VALOR CONTABLE)

11981 Parte de la operación que genera posición larga

11991 Parte de la operación que genera posición corta

G. POSICIONES DE LAS DISTINTAS DIVISAS (DATOS INFORMATIVOS)

POSICIÓN EN DÓLARES DE LOS EE.UU.A. (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

12001 Posición Neta Larga

12101 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN DÓLARES CANADIENSES (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

12201 Posición Neta Larga

12301 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN EUROS (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

12401 Posición Neta Larga

12501 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN YEN JAPONÉS (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

12601 Posición Neta Larga

12701 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN LIBRA ESTERLINA (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

12801 Posición Neta Larga

12901 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN FRANCO SUIZO (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

13001 Posición Neta Larga

13101 Posición Neta Corta

POSICIÓN EN OTRAS DIVISAS (SÓLO PARA LA CASA DE BOLSA)

13201 Posición Neta Larga

13301 Posición Neta Corta

SECCIÓN IV.- OPERACIONES CAMBIARIAS DE LA CASA DE BOLSA CONCERTADAS EL DÍA A QUE CORRESPONDE EL REPORTE

Plazo por vencer: Mismo Día, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9 y 10 días naturales

A. OPERACIONES PESO - DÓLAR DE LOS EE.UU.A. (a su fecha valor, indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

OPERACIONES REALIZADAS CON ENTIDADES MEXICANAS

CELEBRADAS CON INSTITUCIONES DE CRÉDITO:

13401 Importe de las Compras

13501 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON CASAS DE CAMBIO:

13601 Importe de las Compras

13701 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON CASAS DE BOLSA:

13801 Importe de las Compras

13901 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON OTROS INTERMEDIARIOS FINANCIEROS:

14001 Importe de las Compras

14101 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON SECTOR PRIVADO:

14201 Importe de las Compras

14301 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON SECTOR PÚBLICO:

14401 Importe de las Compras

14501 Importe de las Ventas

OPERACIONES REALIZADAS CON ENTIDADES DEL EXTRANJERO

CELEBRADAS CON ENTIDADES FINANCIERAS

14601 Importe de las Compras

14701 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON ENTIDADES NO FINANCIERAS

14801 Importe de las Compras

14901 Importe de las Ventas

B. OPERACIONES DEL PESO CONTRA OTRAS DIVISAS DISTINTAS AL DÓLAR DE LOS EE.UU.A. ASÍ COMO DE DIVISA A DIVISA (a su fecha valor, indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

CELEBRADAS CON INSTITUCIONES DE CRÉDITO MEXICANAS:

15001 Importe de las Compras

15101 Importe de las Ventas

CELEBRADAS CON OTROS:

15201 Importe de las Compras

15301 Importe de las Ventas

SECCIÓN V.- OPERACIONES CAMBIARIAS DE LA CASA DE BOLSA, REALIZADAS CON INSTITUCIONES DE CRÉDITO, CASAS DE CAMBIO MEXICANAS Y OTRAS CASAS DE BOLSA MEXICANAS (IMPORTE TOTAL POR CADA CONTRAPARTE), CONCERTADAS EL DÍA A QUE CORRESPONDE EL REPORTE (EXCLUSIVAMENTE PESO-DÓLAR DE LOS EE.UU.A.)

Institución	Fecha de Concertación	Contraparte	Tipo de Operación (Compra o Venta)	Monto	Fecha de Entrega o Recepción de la Moneda Extranjera

AGRUPACIÓN DE LOS CONCEPTOS DEL FORMULARIO ACLME-PDCB, POR EL DETALLE EN EL PLAZO CON QUE DEBEN REPORTARSE

CLAVE

A.- OPERACIONES QUE DEBERÁN REPORTARSE CON EL SIGUIENTE DETALLE EN EL PLAZO:

Sin Plazo
000

TODOS LOS CONCEPTOS NO SEÑALADOS EN EL APARTADO "B"

B.- OPERACIONES QUE DEBERÁN REPORTARSE CON EL SIGUIENTE DETALLE EN EL PLAZO:

Mismo Día	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
780	001	002	003	004	005	006	007	008	009	010

13401 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Instituciones de Crédito: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

13501 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Instituciones de Crédito: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

13601 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Casas de Cambio: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

13701 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Casas de Cambio: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

13801 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Casas de Bolsa: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

13901 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Casas de Bolsa: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14001 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Otros Intermediarios Financieros: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14101 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Otros Intermediarios Financieros: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14201 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Sector Privado: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14301 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Sector Privado: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14401 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Sector Público: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14501 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Mexicanas. Celebradas con Sector Público: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

14601 Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Del Extranjero. Celebradas con Entidades Financieras: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

Uso Público

Información de acceso público.

14701	Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Del Extranjero. Celebradas con Entidades Financieras: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
14801	Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Del Extranjero. Celebradas con Entidades No Financieras: Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
14901	Operaciones PESO - DÓLAR de los EE.UU.A. Operaciones Realizadas con Entidades Del Extranjero. Celebradas con Entidades No Financieras: Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
15001	Operaciones PESO con Otras Divisas distintas al DÓLAR de los EE.UU.A. y DIVISA - DIVISA. Celebradas con Instituciones de Crédito Mexicanas. Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
15101	Operaciones PESO con Otras Divisas distintas al DÓLAR de los EE.UU.A. y DIVISA - DIVISA. Celebradas con Instituciones de Crédito Mexicanas. Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
15201	Operaciones PESO con Otras Divisas distintas al DÓLAR de los EE.UU.A. y DIVISA - DIVISA. Celebradas con Otros. Importe de las Compras de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)
15301	Operaciones PESO con Otras Divisas distintas al DÓLAR de los EE.UU.A. y DIVISA - DIVISA. Celebradas con Otros. Importe de las Ventas de acuerdo a su fecha valor (indicadas a su correspondiente plazo por vencer)

VALIDACIONES DEL FORMULARIO ACLME - PDCB

VALIDACIONES DE ESTRUCTURA DEL FORMULARIO ACLME-PDCB EN EL SISTEMA DE ACOPIO (SAIF-WEB)

Paquete: ACLMECB Secc I-II COMPLEMENTO y ACLMECB Secc III-IV y V

Núm.	Nombre	Campo(s)	Secciones	Descripción
1	Institución válida	Institución	I, II, III, IV y V	Revisa si la institución está habilitada para el formulario
2	Envíos pendientes	Paquetes de información	I, II, III, IV y V	Valida si existe algún envío pendiente de transmitir
3	Clave de institución válida	Institución	I, II, III, IV y V	La clave de la institución debe corresponder con la información del envío y no puede estar vacía
4	Fecha inicial	Fecha	I, II, III, IV y V	La fecha inicial debe corresponder con la de la información
5	Conceptos con datos	Monto	I, II, III, IV y V	El monto de los conceptos debe tener dato, no puede estar vacío
6	Valor del monto	Monto	I, II, III, IV y V	El monto de los conceptos no debe ser mayor a 99999999999
7	Valor del monto positivo	Monto	I, II, III, IV y V	El monto negativo de los conceptos no está permitido
8	Registros repetidos	Estructura del registro	I, II, III, IV y V	Los registros de los conceptos no pueden estar repetidos
9	Día Hábil	Fechas	I, II, III, IV y V	Las fechas a la que corresponde la información debe ser día hábil
10	Clave de concepto	Concepto	I, II, III, IV	La clave del concepto no puede ser vacía
11	Valor del Plazo	Plazo	I, II, III, IV	El valor del plazo no puede ser vacío
12	Clave del plazo válida	Plazo	I, II, III, IV	Verifica en el catálogo de plazos que la clave de plazos sea válida
13	Concepto válido	Concepto	I, II, III, IV	El concepto debe existir de acuerdo al catálogo
14	Plazo definido	Plazo	I, II, III, IV	El valor del plazo del concepto debe estar definido en el detalle de los plazos

Paquete: ACLMECB Secc III-IV

Núm.	Nombre	Campo(s)	Secciones	Descripción
15	Clave del plazo válida	Concepto	III, IV	Verifica en el catálogo de plazos que la clave de plazos sea válida para el concepto

Paquete: ACLMECB Secc II

Núm.	Nombre	Campo(s)	Secciones	Descripción
16	Días en el calendario	Fecha	II	Verificar que los días estén en el calendario de entrega de información

Paquete: ACLMECB Secc V

Núm.	Nombre	Campo(s)	Secciones	Descripción
17	Clave de contraparte válida	Clave de la contraparte	V	La clave de la contraparte debe existir en el Catálogo de Contrapartes
18	Clave de tipo de operación válida	Tipo de operación	V	La clave del tipo de operación debe ser Compra o Venta
19	Clave de contraparte distinta a clave de institución	Clave la institución y clave de la contraparte	V	La clave de la contraparte debe ser distinta a la clave de la Institución, no pueden tener la misma clave
20	Clave de contraparte con datos	Clave de la contraparte	V	La clave de la contraparte no puede ser vacía
21	Clave de tipo de operación con datos	Tipo de operación	V	La clave de tipo de operación no puede ser vacía
22	Fecha de entrega con datos	Fecha de entrega	V	La fecha de entrega no puede ser vacía
23	Fecha de entrega mayor a la fecha de concertación	Fecha de concertación y fecha de entrega	V	La fecha de entrega no puede ser menor que la fecha de concertación

POSICIONES NETAS

Paquete: ACLMECB Secc III-IV

Núm.	Nombre de Validación	Conceptos	Descripción
24	Posición de las Filiales Financieras Extranjeras (en pesos mexicanos convertidos a dólares)	11401 *o* 11501	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
25	Posición de las Filiales Financieras Mexicanas (en moneda extranjera)	11601 *o* 11701	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
26	Posición Final en moneda extranjera	11801 *o* 11901	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
27	Posición Final en moneda extranjera de la Casa más, en su caso filiales financieras en México y en el exterior	11951 *o* 11971	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
28	Posición en dólares de los EE. UU. A.	12001 *o* 12101	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
29	Posición en dólares canadienses	12201 *o* 12301	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
30	Posición en Euros	12401 *o* 12501	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
31	Posición en Yen Japonés	12601 *o* 12701	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
32	Posición en Libra Esterlina	12801 *o* 12901	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
33	Posición en Franco Suizo	13001 *o* 13101	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)
34	Posición en otras divisas	13201 *o* 13301	Sólo puede tener importe uno de los dos renglones (Sólo puede haber una Posición: es Larga o Corta)

VALIDACIONES DE NEGOCIO DEL FORMULARIO ACLME-PDCB EN EL SISTEMA DE ACOPIO (SAIF-WEB)

Paquete: ACLMECB Secc I-II COMPLEMENTO

Sección I-II

Validaciones de Cruce entre Paquetes					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
1	El concepto 9822 debe ser menor o igual al concepto 3010	9822	≤	3010	G
2	No se ha reportado el concepto 9822 y el concepto 3010 tiene valor	9822	>	0	NG
3	Posición Total = activos - pasivos	[3010 al 3220 + 3382 al 3508 + 3535 al 4710 + 4720 al 4852 + 4930 + 9880 + 9890 + 9930 + 11981] - [6315 al 6405 + 6435 al 7040 + 7050 al 7105 + 7350 al 7355 + 9885 + 9895 + 9940 + 11991]	=	11801-11901	G
4	Operaciones compra-venta divisas vigentes	Operaciones registradas en la Sección IV y que se encuentren vigentes: (13401 + 13601 + 13801 + 14001 + 14201 + 14401 + 14601 + 14801 + 15001 + 15201) – (13501 + 13701 + 13901 + 14101 + 14301 + 14501 + 14701 + 14901 + 15101 + 15301)	=	3535 – 6435 (HOY)	G
Validaciones de Cruce entre Formularios					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
5	Posición de Forwards	Posiciones Vigentes Forwards (OFF): Posición Larga (FWD_POS_L_0023) – Posición Corta (FWD_POS_C_0024)	=	9890 - 9895	G
6	Posición de Futuros	Posiciones Vigentes Futuros (OFF): Posición Larga (FUT_POS_L_0009) – Posición Corta (FUT_POS_C_0010)	=	9880 - 9885	G

[1] Tipo G = Validación Grave, Tipo NG = Validación no Grave

Paquete ACLMECB Secc III-IV y V PREVIO

Sección III-IV

Valida la Información respecto Día Anterior					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
7	Posición de hoy es igual a Posición de ayer más movimientos de hoy	(11801-11901)AYER + (10001 + 10101 + 10201 + 10301 + 10401 + 10416 + 10421 + 10451 + 10501 + 10521 + 10551 + 10851 + 10951 + 11051 + 11151) - (10051 + 10151+10251 + 10351 + 10601 + 10616 + 10621 + 10651 + 10701 + 10721 + 10751 + 10801 + 10901 + 11001 + 11101) + [(11201 - 11301) HOY - [(11201 - 11301)AYER]	=	(11801-11901) HOY	G
Validaciones de Consistencia misma Sección					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
8	Total de Compras	13401 + 13601 + 13801 + 14001 +1 4201 + 14401 + 14601 + 14801 + 15001 + 15201	=	10001	G
9	Total de Ventas	13501 + 13701 + 13901 + 14101 + 14301 + 14501 + 14701 + 14901 + 15101 + 15301	=	10051	G
10	Posición Casa de Bolsa más Filiales	(11801 - 11901) +(11401 - 11501) + (11601 - 11701)	=	11951-11971	G
11	Posición Global y por Divisa	(12001 – 12101 + 12201 – 12301 + 12401 – 12501 + 12601 – 12701 + 12801 – 12901 + 13001 – 13101 + 13201 - 13301)	=	11801-11901	G
12	Fecha de Entrega de las operaciones	Fecha de Información + plazo (en días naturales)	!=	Sábado o Domingo	G
Validaciones de Cruce entre Secciones del mismo Paquete					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
13	Compras de dólares a Bancos	Suma de Compras a Bancos reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 040 y 037)	=	13401	G
14	Ventas de dólares a Bancos	Suma de Ventas a Bancos reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 040 y 037)	=	13501	G
15	Compras de dólares a Casas de Bolsa	Suma de Compras a Casas de Bolsa reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 013)	=	13801	G
16	Ventas de dólares a Casas de Bolsa	Suma de Ventas a Casas de Bolsa reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 013)	=	13901	G
17	Compras de dólares a Casas de Cambio	Suma de Compras a Casas de Cambio reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 016)	=	13601	G
18	Ventas de dólares a Casas de Cambio	Suma de Ventas a Casas de Cambio reportadas en la Sección V (clave de contraparte inicia con 016)	=	13701	G

Validaciones de Cruce entre Formularios					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
19	Concertaciones de Futuros posición Larga	Concertaciones de Futuros que generan posición Larga (Formulario OFF) FUT_POS_L_0001	=	10101	G
20	Concertaciones de Futuros posición Corta	Concertaciones de Futuros que generan posición Corta (Formulario OFF) FUT_POS_C_0002	=	10151	G
21	Concertaciones de Forwards posición Larga	Concertaciones de Forwards que generan posición Larga (Formulario OFF) FWD_POS_L_0011	=	10201	G
22	Concertaciones de Forwards posición Corta	Concertaciones de Forwards que generan posición Corta (Formulario OFF) FWD_POS_C_0012	=	10251	G
23	Vencimientos de Futuros posición Larga	Vencimientos de Futuros de posición Larga (Formulario OFF) FUT_POS_L_0007	=	10801	G
24	Vencimientos de Futuros posición Corta	Vencimientos de Futuros de posición Corta (Formulario OFF) FUT_POS_C_0008	=	10851	G
25	Vencimientos de Forwards posición Larga	Vencimientos de Forwards de posición Larga (Formulario OFF) FWD_POS_L_0021	=	10901	G
26	Vencimientos de Forwards posición Corta	Vencimientos de Forwards de posición Corta (Formulario OFF) FWD_POS_C_0022	=	10951	G
Validaciones de Cruce entre Paquetes					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
3	Posición Total = activos - pasivos	[3010 al 3220 + 3382 al 3508 + 3535 al 4710 + 4720 al 4852 + 4930 + 9880 + 9890 + 9930 + 11981] - [6315 al 6405 + 6435 al 7040 + 7050 al 7105 + 7350 al 7355 + 9885 + 9895 + 9940 + 11991]	=	11801-11901	G
4	Operaciones compra-venta divisas vigentes	Operaciones concertadas que se encuentren vigentes: (13401 + 13601 + 13801 + 14001 + 14121 + 14201 + 14401 + 14601 + 14801 + 15001 + 15121 + 15201 + 16001 + 16121 + 16201) – (13501 + 13701 + 13901 + 14101 + 14151 + 14301 + 14501 + 14701 + 14901 + 15101 + 15151 + 15301 + 16101 + 16151 + 16301)	=	3535 – 6435 (HOY)	G

Sección V

Validaciones de Consistencia misma Sección					
Núm.	**Nombre**	**A**	**Oper.**	**B**	**Tipo[1]**
27	Fecha de entrega diferente a sábado o domingo	Fecha de entrega	!=	Sábado o Domingo	G
28	Plazo de las operaciones	Fecha de Entrega – Fecha de Información	<=	11 días hábiles	G

VALIDACIONES DE NEGOCIO DEL FORMULARIO ACLME-PDCB FUERA DEL SISTEMA DE ACOPIO (SAIFWEB)

Nombre	A	Oper.	B	
Arrastre de Posición de la Casa de Bolsa	$PosiciónReportada_t = 11801_t - 11901_t$	=	$PosiciónCalculada_t =$	Posición Calculada del día
			$PosiciónCalculada_{t-1} +$	Posición Calculada del día anterior
			$10001_t - 10051_t + 10101_t - 10151_t + 10201_t - 10251_t + 10301_t - 10351_t$	Concertaciones del propio día
			$(del\ 10401_t\ al\ 10551_t) - (del\ 10601_t\ al\ 10751_t) +$	Otros Movimientos del día
			$10801_t - 10851_t + 10901_t - 10951_t + 11001_t - 11051_t + 11101_t - 11151_t +$	Vencimientos del día
			$(11201_t - 11301_t) - (11201_{t-1} - 11301_{t-1})$	Variación de Posición de Opciones
			Por construcción se asume que para la primer fecha del rango (t_0, t_n): $PosiciónCalculada_{t_0} = PosiciónReportada_{t_0}$	

Nombre	A	Oper.	B	
Operaciones Cambiarias Vigentes	***Sección I*** ***Operaciones Cambiarias de Comp*** 3535_t	=	***Sección IV*** ***Operaciones Cambiarias de Compra Vigentes en t*** $13401_t + 13601_t + 13801_t + 14001_t + 14201_t + 14401_t + 14601_t + 14801_t + 15001_t + 15131_t + 15201_t$	
	Sección I ***Operaciones Cambiarias de Venta*** 6435_t	=	***Sección IV*** ***Operaciones Cambiarias de Venta Vigentes en t*** $13501_t + 13701_t + 13901_t + 14101_t + 14301_t + 14501_t + 14701_t + 14901_t + 15101_t + 15161_t + 15301_t$	
Billetes y Monedas (Dólares de los EE.UU.A.)	9822 Billetes y Monedas (exclusivamente dólares de los EE.UU.A. Dato informativo)	<=	3010 Billetes y Monedas Extranjero (Caja)	
<u>Discrepancias</u> **Valida que las operaciones de compraventa de divisas, sean iguales a las operaciones de compraventa divisas reportadas por sus contrapartes**	Reportado por la casa de cambio: fecha de concertación, fecha de liquidación y monto de la operación	=	Reportado por la contraparte: fecha de concertación, fecha de liquidación, monto de la operación	***Operaciones celebradas con:*** - ***Instituciones de Crédito,*** - ***Casas de Bolsa y*** - ***Casas de Cambio*** ***reconociéndose como contraparte entre ellas***
	Tipo de operación	<>	Tipo de operación	

CATÁLOGOS Y ANEXOS

CATÁLOGO DE CONTRAPARTES (SECCIÓN V) DEL FORMULARIO ACLME-PDCB DE LAS CASAS DE BOLSA

Únicamente aplican las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Casas de Cambio

CASFIM: Catálogo del Sistema Financiero Mexicano

CALENDARIO DE ENTREGA DE INFORMACIÓN DE LAS SECCIONES I Y II, DEL FORMULARIO ACLME-PDCB

2024		
Mes	**Fecha de Información**	**Fecha límite de envío**
Enero	5	12
	12	19
	19	26
	26	2 de Febrero
	31	8 de Febrero
Febrero	9	16
	16	23
	23	1 de Marzo
	29	7 de Marzo
Marzo	8	15
	15	25
	22	2 de Abril
	27	5 de Abril
Abril	5	12
	12	19
	19	26
	30	8 de Mayo
Mayo	10	17
	17	24
	24	31
	31	7 de Junio
Junio	7	14
	14	21
	21	28
	28	5 de Julio
Julio	5	12
	12	19
	19	26
	26	2 de Agosto
	31	7 de Agosto
Agosto	9	16
	16	23
	23	30
	30	6 de Septiembre
Septiembre	6	13
	13	23
	20	27
	30	8 de Octubre
Octubre	4	11
	11	18
	18	25
	25	1 de Noviembre
	31	7 de Noviembre
Noviembre	8	15
	15	25
	22	29
	29	6 de Diciembre
Diciembre	6	16
	13	20
	20	30
	31	8 de Enero 2025

BANCO DE MÉXICO
www.banxico.org.mx