



BANCO DE MÉXICO

**Ayudas del Formulario relativo a las operaciones de
Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito,
Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).**

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

CONTENIDO

Ayudas Generales.....	4
I. Fundamento Legal del requerimiento de información.....	4
II. Objetivo del requerimiento.....	6
III. Definiciones.....	6
IV. Cobertura del formulario.....	6
V. Contenido del formulario.....	7
VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos del Banco de México....	7
VII. Fecha y horario de entrega de la información.....	8
VIII. Actualización de catálogos o anexos.....	8
IX. Estructura del formulario por sección.....	9
Ayudas específicas para cada campo del formulario.....	14
Sección I, relativa a las operaciones celebradas en mercados reconocidos (bursátiles).....	14
Sección II, relativa a las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	16
Sección III, información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	26
Sección IV, información de la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones celebradas, tanto en mercados reconocidos, como no reconocidos.....	30
Sección V, información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.....	32
Sección VI, información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.....	34
Validaciones de negocio para cada campo del formulario que se realizarán en el Saif-web.....	36
Sección I, relativa a las operaciones celebradas en mercados reconocidos (bursátiles).....	36
Sección II, relativa a las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	38
Sección III, relativa a la información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	47
Sección IV, relativa a la información de la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones celebradas, tanto en mercados reconocidos, como no reconocidos.....	52
Sección V, relativa a la información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.....	54

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Sección VI, relativa a la información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos. 56

FORMULARIO RELATIVO A OPERACIONES DE DERIVADOS DE CRÉDITO, PARA LAS INSTITUCIONES DE CRÉDITO Y CASAS DE BOLSA (DC)

Ayudas Generales

I. Fundamento Legal del requerimiento de información.

Ley de Instituciones de Crédito, Artículo 97

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

Ley del Banco de México, artículo 36.

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

Reglamento Interior del Banco de México, artículo 25 Bis, fracción I.

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

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

Circular 3/2012 del Banco de México, artículo 108.

Información al Banco de México.

“Las Instituciones deberán proporcionar a la Dirección General de Asuntos del Sistema Financiero, a la Dirección General de Operaciones de Banca Central, a la Dirección General de Estrategia, Riesgos y Sistemas de Pagos, así como a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

México, la información que, en el ámbito de su competencia, dichas unidades administrativas les requieran.

La referida información deberá remitirse en la forma y términos que les den a conocer las mencionadas unidades administrativas.”

Circular 4/2012 del Banco de México

Información.

“Las Entidades (Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y la Financiera), los Fondos de Inversión, los Almacenes Generales de Depósito y las Sofomes que celebren Operaciones Derivadas, incluidas aquellas que formen parte de Operaciones Estructuradas documentadas en los títulos que emitan o adquieran deberán proporcionar la información sobre dichas operaciones, en los términos, forma y plazos que el Banco de México establezca, a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México.

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

[...]

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

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

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

“Las sociedades financieras de objeto múltiple reguladas y no reguladas, deberán proporcionar la información o documentación que les requieran en el ámbito de su competencia la Secretaría de Hacienda y Crédito Público, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, el Banco de México y la Comisión Nacional para la Protección y Defensa de los Usuarios de Servicios Financieros, dentro de los plazos que tales autoridades señalen”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

II. Objetivo del requerimiento.

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para, según sea el caso, determinar diversos indicadores relativos al volumen de las operaciones de derivados de crédito, medición de la exposición al riesgo de las instituciones por dichas operaciones, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.”

III. Definiciones.

Para efectos de este formulario se entenderá como:

- Operaciones (u Operaciones de Derivados de Crédito), a los Derivados de Incumplimiento Crediticio, a los Derivados de Rendimiento Total, a los Títulos con Vinculación Crediticia y a cualquier otra operación derivada u Operación Estructurada en la que se estipule el ejercicio de un derecho o el cumplimiento de una obligación cuando se presente un Evento Crediticio.
- Activo de Riesgo, Comprador de Protección, Derivados de Incumplimiento Crediticio, Derivados de Rendimiento Total, Día hábil, Divisas, Evento Crediticio, Fecha de liquidación, Liquidación, Mercados reconocidos, Operaciones Estructuradas, Riesgo de Crédito, Subyacentes, Títulos con Vinculación Crediticia y Vendedor de Protección, a lo señalado en la Circular 4/2012 del Banco de México.
- Operaciones en “mercados no reconocidos”, a las operaciones celebradas en mercados distintos a los reconocidos, incluyendo los mercados extrabursátiles (OTC: “Over the counter”).
- Paquetes de derivados (negociados tanto en mercados reconocidos como OTC), a la contratación simultánea de operaciones derivadas, que pueden o no ser de la misma naturaleza, al amparo de una sola transacción. Un caso particular de “paquete de derivados” son los “Derivados de Rendimiento Total” negociados en mercados OTC, los cuales consisten en un “Swap” que tiene incrustado un “Derivado de Incumplimiento Crediticio”.

IV. Cobertura del formulario.

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

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

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

Las preguntas que se hacen sobre ciertos términos y condiciones de las operaciones, las diversas instrucciones de llenado del formulario, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo deberán

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

considerarse como parte de la normatividad o como una interpretación a ésta o como un consentimiento o convalidación o autorización de la autoridad para realizar tales operaciones o para realizarlas en términos y condiciones que no se ajusten a las disposiciones aplicables vigentes.

V. Contenido del formulario.

El formulario deberá contener todas las operaciones de derivados de crédito (incluyendo las implícitas en notas, títulos u Operaciones Estructuradas), una a una. Al efecto, en el caso de “operaciones estructuradas” o de “paquete de derivados”, a las que se refiere la ayuda general III, la institución deberá desagregar e informar cada una de las operaciones individuales comprendidas en una misma transacción o contrato. El formulario está compuesto por las seis secciones siguientes:

Sección I. Comprende las operaciones celebradas en mercados reconocidos.

Sección II. Comprende las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.

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

Sección IV. Para informar la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones que fueron previamente informadas en las secciones I y II.

Sección V. Para informar la convalidación de las operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.

Sección VI. Para informar la convalidación de las operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.

VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos del Banco de México.

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

Bloque: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo (que deben ser todas las operaciones relativas a una misma fecha de concertación, de vencimiento anticipado o de corte), se van a incorporar a la base de datos en “bloque” (Esta opción aplica para todas las secciones del formulario).

Alta: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para incorporar a la base registros por operaciones omitidas en envíos anteriores (es decir, dar de alta registros). Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II, III y IV) del formulario.

Baja: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para eliminar de la base registros por operaciones improcedentes de envíos anteriores. Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II, III, y IV del formulario.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Cambios: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para modificar de la base registros enviados con anterioridad (es decir, se modifica al menos un campo de la operación). Esta opción aplica exclusivamente para las secciones I, II, III, y IV del formulario.

VII. Fecha y horario de entrega de la información.

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

Las secciones III y IV de este formulario deberán enviarse en la misma fecha del evento de vencimiento anticipado, de terminación o extinción, cesión de derechos o de ocurrencia del Evento Crediticio de que se trate, antes de las 17:30 Horas (utilizando la opción de “Bloque” a que se refiere la ayuda general VI).

En caso que la institución se percate que uno o más registros no fueron enviados en su fecha de concertación, de vencimiento anticipado, de terminación o extinción, de cesión de derechos, o de ocurrencia del Evento Crediticio; o que fueron enviados por error, o que alguna característica requiere ser modificada, entonces se deben enviar los registros de alta, baja y/o de cambio que correspondan (ya sea en la sección I, II, III, y/o IV), utilizando las opciones “Alta”, “Baja” o “Cambios”, respectivamente, a que se refiere la ayuda general VI.

Por su parte, las secciones V y VI deberán enviarse con periodicidad mensual (con información de las fechas de corte disponibles en el SAIF-Web), a más tardar a las 20:00 horas del tercer día hábil bancario posterior al último día hábil del mes que corresponda (para estas secciones aplica exclusivamente la opción de Bloque a que se refiere la Ayuda General VI). El soporte técnico relacionado con el acceso a las personas usuarias, así como la operación del sistema de acopio, es de las 8:00 a las 20:30 de lunes a viernes en días hábiles bancarios.

No obstante, el envío de los paquetes deberá realizarse en un horario de 9:00 a 21:00 horas.

VIII. Actualización de catálogos o anexos.

En caso que en un determinado Catálogo o Anexo no exista una clave para identificar algún evento o categoría en particular (por ejemplo, un tipo de subyacente en el Anexo “F”, o un socio liquidador en el Anexo “O”), las Instituciones podrán solicitar al Banco de México, la inclusión de nuevo(s) evento(s) y clave(s), a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx, indicando el catálogo o anexo y el evento o categoría faltante.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

IX. Estructura del formulario por sección

Nota aplicable a todos los “Layouts”: En el caso de campos tipo “Numérico”, el primer dígito entre paréntesis corresponde al número máximo de posiciones enteras (excepto en el caso de Catálogos o Anexo que son de largo fijo), mientras que el segundo, al número máximo de posiciones decimales.

Estructura de la Sección I: Operaciones celebradas en mercados reconocidos (bursátiles)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	LEI_INST	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
4	MERCADO	MERCADO	ANEXO S	CARÁCTER	3
5	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
6	POS_PRTDE	POSICIÓN EN LA PROTECCIÓN		CARÁCTER	1
7	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
8	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
9	NUMCONTRAT	NÚMERO DE CONTRATOS		NUMÉRICO	(6,0)
10	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
11	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA O EL COSTO DE LA PROTECCIÓN	ANEXO E	CARÁCTER	3
12	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
13	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
14	OPER_DER	OPERADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO P	CARACTER	6
15	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)

Estructura de la Sección II: Operaciones celebradas en mercados no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	LEI_INST	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
4	CONTRAPAR	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	CARÁCTER	20
5	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FECINI	FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE PROTECCIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

7	FECVEN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL PERÍODO DE PROTECCIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
8	DIASLIQ	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LA LIQUIDACIÓN, EN CASO DEL EVENTO CREDITICIO		NUMÉRICO	(2,0)
9	POS_COB	POSICIÓN EN LA PROTECCIÓN		CARACTER	1
10	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
11	IMP_COBTA	IMPORTE DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
12	MDA_IMP_CO	MONEDA DEL IMPORTE DE LA PROTECCIÓN	ANEXO E	CARÁCTER	3
13	TAS_REC	TASA DE RECUPERACIÓN APLICABLE AL ACTIVO DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(5,2)
14	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
15	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA O EL COSTO DE LA PROTECCIÓN	ANEXO E	CARÁCTER	3
16	FRE_PRM	FRECUENCIA DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		ALFANUMÉRICO	2
17	DIA_PRM	DÍA NATURAL DEL PAGO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(2,0)
18	FE_PRIM	FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
19	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE".	ANEXO J	CARÁCTER	2
20	ID_PAQ_EST	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	20
21	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
22	ACT_REF	TIPO DE SUBYACENTE (ACTIVO DE REFERENCIA)	ANEXO F	CARÁCTER	2
23	EMI_REF	EMISORA O DEUDORA DEL ACTIVO DE REFERENCIA	ANEXO B	CARÁCTER	20
24	CVE_TIT	CLAVE DEL TÍTULO DE DEUDA DE REFERENCIA	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
25	IMP_ACT_REF	IMPORTE DEL ACTIVO DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(15,0)
26	MDA_AC_RE	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADO EL IMPORTE DEL ACTIVO DE REFERENCIA	ANEXO E	CARÁCTER	3
27	FE_VE_AR	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ACTIVO DE REFERENCIA		FECHA	AAAA/MM/DD
28	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(13,6)
29	PRECIOEJER2	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS		NUMÉRICO	(13,6)
30	TIP_EV_CR	TIPO DE EVENTO CREDITICIO DE LA OPERACIÓN	ANEXO AK	ALFANUMÉRICO	23
31	N_DEFAULT	NÚMERO DEL ACTIVO DE REFERENCIA EN INCUMPLIMIENTO PARA ACTIVARSE LA PROTECCIÓN		CARÁCTER	2
32	PAGO_DEFAULT	FORMA DE PAGO DEL O LOS ACTIVOS DE REFERENCIA EN DEFAULT (PARA CANASTAS)		CARÁCTER	2
33	MOD_LIQ	MODALIDAD DE LIQUIDACIÓN, EN CASO DEL EVENTO CREDITICIO		CARÁCTER	1

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

34	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	CARÁCTER	2
35	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	CARÁCTER	2
36	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARÁCTER	6
37	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	CARÁCTER	2
38	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
39	REP_DEV	REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	CARACTER	6
40	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
41	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	34
42	UPI	IDENTIFICADOR ÚNICO DEL PRODUCTO		ALFANUMÉRICO	12
43	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
44	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

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

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

15	UTI_O	UTI ORIGINAL		ALFANUMÉRICO	52
16	UTI_N	UTI NUEVO		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección IV: Información de la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones celebradas, tanto en mercados reconocidos, como no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	LEI_INST	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
4	SEC_DCR	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
5	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
6	FE_EVE	FECHA DE OCURRENCIA DEL EVENTO CREDITICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE_LIQ	FECHA DE LIQUIDACIÓN DE LA PROTECCIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
8	MOD_LIQ	MODALIDAD DE LIQUIDACIÓN, EN CASO DEL EVENTO CREDITICIO		CARÁCTER	1
9	IMP_LIQ	IMPORTE LIQUIDADO POR LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,1)
10	MDA_LIQ	MONEDA DEL IMPORTE LIQUIDADO	ANEXO E	CARÁCTER	3
11	IMP_ACT_REF	VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA, EN LA FECHA DEL EVENTO CREDITICIO		NUMÉRICO	(15,0)
12	CVE_TIT_LIQ	CLAVE DEL TÍTULO DE DEUDA RECIBIDO O ENTREGADO PARA LA LIQUIDACIÓN	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
13	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección V: Información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	LEI_INST	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
6	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

7	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
8	ACT_REF_MD	VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(15,0)
9	ID_GAR_VIG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20

Estructura de la Sección VI: Información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	LEI_INST	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
6	ID_PAQ_EST	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	20
7	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
8	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
9	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
10	ACT_REF_MD	VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(15,0)
11	ID_GAR_VIG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
12	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Ayudas específicas para cada campo del formulario

Sección I, relativa a las operaciones celebradas en mercados reconocidos (bursátiles)

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

3. OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN.

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

4. MERCADO.

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

5. FECHA DE CONCERTACIÓN.

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

6. POSICIÓN EN LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar:

- | | |
|---|-----------------------------------------------------|
| C | Cuando la Institución adquiera (compre) PROTECCIÓN. |
| V | Cuando la Institución otorgue (venda) PROTECCIÓN. |

7. CLAVE DE PIZARRA.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Se deberá anotar la “clave de pizarra” relativa a la operación, conforme al “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA.

8. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN.

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

9. NÚMERO DE CONTRATOS.

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

10. IMPORTE DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar el importe total de la prima o del costo de la protección relativa a la operación, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

11. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA O EL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe de la prima (campo 10), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

12. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar un número para identificar a cada registro, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la Institución internamente para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 5).

13. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN.

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

14. OPERADOR DE LA OPERACIÓN.

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

Tratándose de opciones no concertadas a través de dichas entidades, en este campo se deberá anotar la clave “076000” (No aplica).

Uso Público

Información de acceso público.

15. CÁMARA DE COMPENSACIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada a la “Cámara de Compensación” por medio de la cual se liquidará la operación celebrada en el mercado a que se refiere el campo 4, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación” a que se refiere el Anexo L.

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

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

3. OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN.

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

4. CLAVE DE LA CONTRAPARTE.

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

5. FECHA DE CONCERTACIÓN.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

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

6. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la fecha de inicio del período de PROTECCIÓN, relativo a la operación, con formato AAAA/MM/DD.

7. FECHA DE VENCIMIENTO DEL PERÍODO DE PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (o fin) del período de PROTECCIÓN, relativo a la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LA LIQUIDACIÓN, EN CASO DEL EVENTO CREDITICIO.

Se deberá anotar, en su caso, el número de días hábiles previstos para liquidar el importe de la PROTECCIÓN relativo a la operación, posteriores a la fecha de materialización del evento crediticio correspondiente.

En caso que la liquidación se realice en la misma fecha en que el evento crediticio se materialice, se deberá reportar "0" (cero) en este campo.

Adicionalmente, si para una operación en particular el Número de Días Hábiles para la Liquidación, en Caso del Evento Crediticio resulte mayor a ocho días, las Instituciones deberán solicitar al Banco de México la apertura de la validación del sistema de acopio para el envío de dicho número de días. La solicitud deberá realizarse a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx, indicando las características que identifiquen la operación.

9. POSICIÓN EN LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar:

- C Cuando la Institución adquiera (compre) PROTECCIÓN.
- V Cuando la Institución otorgue (venda) PROTECCIÓN.

10. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN.

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

11. IMPORTE DE LA PROTECCIÓN.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que la PROTECCIÓN se otorga a través de un importe (monetario) fijo, se deberá anotar dicho importe, en miles (redondeado sin decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato.

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de derivados de crédito conocidos como “Swaptions digitales sobre incumplimiento crediticio”, se deberá anotar el importe (monetario) fijo que corresponde a la parte del Swap del derivado de crédito.

En el caso de operaciones cuyo contrato establezca que la PROTECCIÓN se otorga como un porcentaje del valor de mercado o contable del activo de referencia, en este campo deberá reportarse cero (0).

12. MONEDA DEL IMPORTE DE LA PROTECCIÓN.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que la PROTECCIÓN se otorga a través de un importe (monetario) fijo, se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado dicho importe (campo 11), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En el caso de operaciones cuyo contrato establezca que la PROTECCIÓN se otorga como un porcentaje del valor de mercado o contable del activo de referencia, en este campo deberá reportarse “0” (equivalente a No aplica).

13. TASA DE RECUPERACIÓN APLICABLE AL ACTIVO DE REFERENCIA.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca una tasa de recuperación, como un porcentaje fijo del valor nominal (o saldo insoluto) del activo de referencia de que se trate, se deberá anotar dicho porcentaje, con enteros y dos decimales. Por ejemplo, si la tasa de recuperación contractual es de 35 por ciento, entonces este campo debe ser igual a 35.

En el caso de operaciones cuyo contrato establezca que la protección se otorga a través de un importe (monetario) fijo, y/o la tasa de “tasa de recuperación” pre-determinada es igual a “0” (cero) en este campo debe reportarse “100” (cien).

14. IMPORTE DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar el importe de la prima o del costo de la PROTECCIÓN, que corresponda al periodo completo de protección (o, en su caso, al primer periodo) de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato.

En el caso de Derivados de Rendimiento Total o de Títulos con Vinculación Crediticia, en este campo podrá reportarse cero (0), conforme a lo establecido en el contrato de que se trate.

15. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la clave que corresponda a la moneda en que está expresado el importe de la prima o del costo de la PROTECCIÓN (campo 14), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

16. FRECUENCIA DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la clave que corresponda a la frecuencia del cobro o pago de la prima o costo de la PROTECCIÓN, conforme al “Catálogo de frecuencia de la prima o del costo de la protección” a que se refiere el Anexo AP.

Por ejemplo, en el caso de operaciones en las que la prima o el costo de la PROTECCIÓN se cobre o pague una sola vez dentro del periodo señalado en el contrato de que se trate (es decir, al que se refieren los campos 6 y 7, relativos a la fecha de inicio y de vencimiento, respectivamente, del periodo de protección), entonces se debe anotar “U”.

17. DÍA NATURAL DEL PAGO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

En caso que la prima o el costo de la PROTECCIÓN de la operación, se cobre o pague con una frecuencia determinada, dentro del periodo de protección señalado en el contrato de que se trate (es decir, al que se refieren los campos 6 y 7, relativos a la fecha de inicio y de vencimiento, respectivamente, del periodo de protección), en este campo se deberá anotar el día fijo de cada mes en que se realice dicho cobro o pago. Por ejemplo, si el cobro o pago de la prima se realiza cada día 15 de mes, entonces en este campo deberá registrarse 15 (quince).

En el caso de operaciones en las que la prima o el costo de la PROTECCIÓN se cobre o pague una sola vez dentro del periodo señalado en el contrato de que se trate (es decir, al que se refieren los campos 6 y 7, relativos a la fecha de inicio y de vencimiento, respectivamente, del periodo de protección), entonces se debe anotar “0” (cero).

18. FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la fecha de pago o cobro (a que se refiere el campo “14-Importe de la Prima o del Costo de la Protección”) de la prima, o del costo de la PROTECCIÓN de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

En caso que la prima o el costo de la PROTECCIÓN de la operación, se cobre o pague con una frecuencia mayor que “0” (cero), se debe anotar la fecha pago o cobro del primer periodo de protección (la que corresponda a lo reportado en el campo “14-Importe de la Prima o del Costo de la Protección”).

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

Se deberá anotar la clave que corresponda conforme al “Catálogo de Operaciones Estructuradas o Paquetes de Derivados” a que se refiere el Anexo J. En particular, en el caso de “Derivados de Incumplimiento Crediticio” sobre dos o más activos de referencia, se deberán reportar como si fuera un paquete con el mismo número de registros que el número de activos de referencia contemple el contrato correspondiente.

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de derivados de incumplimiento crediticio conocidos como “Opción sobre Swap de incumplimiento crediticio”, claves 60, 61, 62 o 63 de este campo, se deberá reportar un registro para la parte de la opcionalidad, y otro registro que se refiera al derivado de crédito “Swap sobre incumplimiento crediticio”, claves 55 o 56 de este campo. Ambas operaciones deberán tener el mismo valor del campo 20 y el campo 21 deberá tener un valor secuencial.

En el caso de derivados de incumplimiento crediticio conocidos como “Título con Vinculación Crediticia” se deberá reportar un registro que contemple dicho Título, clave 58 de este campo, y otro(s) registro(s) que se refieran en específico a los derivados de incumplimiento crediticio que conforma el título con vinculación crediticia. Estas operaciones deberán tener el mismo valor del campo 20 y el campo 21 deberá tener un valor secuencial.

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

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, se deberá anotar la clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte de la misma “operación estructurada” o “paquete”. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinada “operación estructurada” o “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

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

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las operaciones individuales que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”. Cada grupo de operaciones relativas a una determinada “operación estructurada” o “paquete”, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1). Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más operaciones individuales que tengan la misma clave de institución (campo 1), fecha de concertación (campo 5) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 20).

22. TIPO DE SUBYACENTE (ACTIVO DE REFERENCIA).

Se deberá anotar la clave que corresponda al activo de referencia de la operación de que se trate, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente (Activos de Referencia)” a que se refiere el Anexo F.

23. EMISORA O DEUDORA DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Uso Público

Información de acceso público.

Tratándose de operaciones cuyo activo de referencia sea un préstamo o crédito a cargo de entidades residentes en México o el extranjero (claves “PCM” o “PCE” en el campo 22), se deberá anotar la clave que corresponda a la emisora o deudora del activo de referencia de la operación de que se trate, conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B.

En cualquier otro caso, este campo deberá ser vacío.

24. CLAVE DEL TÍTULO DE DEUDA DE REFERENCIA.

Tratándose de operaciones cuyo activo de referencia sea un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 22), una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 22), un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 22), o un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 22) una se deberá anotar la “clave” que corresponda al título de deuda de que se trate, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio” a que se refiere el Anexo AF.

En el caso de operaciones cuyo activo de referencia sea distinto de los mencionados títulos, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

25. IMPORTE DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Se deberá anotar el valor de mercado o contable del activo de referencia relativo a la operación de que se trate, a la fecha de concertación correspondiente (campo 5), en miles (redondeado, con un decimal) de la moneda de denominación de dicho activo de referencia.

26. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL IMPORTE DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Se deberá anotar la clave que corresponda a la moneda en que está expresado el valor de mercado o contable del activo de referencia (campo 25), de acuerdo al contrato respectivo, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

27. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Tratándose de operaciones cuyo activo de referencia sea un préstamo o crédito a cargo de entidades residentes en México o el extranjero (claves “PCM” o “PCE” en el campo 22), se deberá anotar la fecha de vencimiento del activo de referencia relativo a la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

Uso Público

Información de acceso público.

28. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO.

Tratándose de operaciones de derivados de crédito cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en su fecha de concertación (campo 5), en este campo se deberá anotar el precio por unidad de subyacente o tasa de ejercicio pactado(a) en la operación de que se trate.

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

29. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS.

Tratándose de operaciones de derivados de crédito cuyo contrato establezca un segundo precio o tasa de ejercicio determinado en su fecha de concertación (campo 5), en este campo se deberá anotar el precio por unidad de subyacente o tasa de ejercicio pactado(a) en la operación de que se trate.

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

30. TIPO DE EVENTO CREDITICIO DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar la clave que corresponda al tipo de evento crediticio cubierto a través de la operación de que se trate, conforme al “Catálogo de Tipos de Eventos Crediticios” a que se refiere el Anexo AK.

31. NÚMERO DE ACTIVOS DE REFERENCIA EN INCUMPLIMIENTO PARA ACTIVARSE LA PROTECCIÓN.

En caso que el activo de referencia se refiera a una canasta, se deberá anotar el número del activo condicionado al evento crediticio. Por ejemplo, si el activo de referencia se compone de cuatro títulos de deuda, y el evento crediticio está estipulado como “Los primeros dos incumplimientos de la cartera”, entonces se debe anotar “2” (dos).

Tratándose de un solo activo de referencia, se debe anotar “1” (uno).

32. FORMA DE PAGO DEL O LOS ACTIVOS DE REFERENCIA EN DEFAULT (PARA CANASTAS)

Se deberá anotar:

0 Tratándose de Derivados de Incumplimiento Crediticio sobre un solo activo de referencia.

Uso Público

Información de acceso público.

- 1 Tratándose de Derivados de Incumplimiento Crediticio sobre dos o más activos de referencia, y se cobre o pague el incumplimiento de cada activo de referencia que haya cumplido con el evento crediticio.
- 2 Tratándose de Derivados de Incumplimiento Crediticio sobre dos o más activos de referencia, y se cobre o pague únicamente el último incumplimiento del activo de referencia que haya cumplido con el evento crediticio.

Por ejemplo, en un Derivado de Incumplimiento Crediticio compuesto por tres títulos de deuda cuyo evento crediticio se refiera al incumplimiento de los tres activos de referencia (campo 31 igual a "3"), si el cobro o pago a liquidar es la suma del importe o tasa de recuperación sobre los tres activos de referencia, entonces el valor de este campo es igual a "1". Si, al contrario, únicamente se cobra o paga el importe o tasa de recuperación del tercer activo de referencia, entonces el valor de este campo es igual a "2".

33. MODALIDAD DE LIQUIDACIÓN, EN CASO DEL EVENTO CREDITICIO.

Se deberá anotar:

- S Cuando la operación tenga que ser liquidada mediante la entrega "física" del activo de referencia, en caso que se materialice el evento crediticio.
- D Cuando la operación tenga que ser liquidada únicamente "por diferencias" (o en efectivo), en caso que se materialice el evento crediticio.
- M Cuando la operación pueda que ser liquidada "por diferencias" (o en efectivo), o por la entrega "física" del activo de referencia, a solicitud de la contraparte en caso que se materialice el evento crediticio.

34. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO.

Se deberá anotar la "clave" del tipo del producto derivado que corresponda a la operación, conforme al "Catálogo de Tipo de Producto Derivado" a que se refiere el Anexo C.

35. PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN.

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la "Plataforma de Negociación", por medio de la cual se concertó la operación, conforme al "Catálogo de Plataformas de Negociación" a que se refiere el Anexo K.

Tratándose de operaciones no concertadas a través de dichas plataformas, en este campo se deberá anotar la clave "90" (equivalente a no aplica).

36. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” por medio del cual se liquidará la operación, en la cámara de compensación a que se refiere el campo 37, conforme al “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

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

37. CÁMARA DE COMPENSACIÓN.

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

Tratándose de operaciones que no se liquidarán a través de dichas cámaras, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

38. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN.

En caso que la operación no se liquide en una “Cámara de Compensación”, se deberá anotar la clave de la entidad que, de acuerdo al contrato de la operación, actúa como agente de cálculo y/o liquidación; conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B.

En caso que la institución sea agente de cálculo, la clave que se reporte deberá ser la misma que el campo 1; mientras que, si la contraparte actúa como agente de cálculo, la clave que se reporte deberá ser la misma que el campo 4. Si de acuerdo al contrato de que se trate, las dos partes de la operación actúan como agente de cálculo y/o liquidación se deberá registrar la clave “000111”.

39. REPOSITORIO DE DERIVADOS

En su caso, se deberá anotar la clave correspondiente al “Repositorio de Derivados” en el que se registró la operación, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

Tratándose de operaciones que no están registradas en algún Repositorio de Derivados, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

40. CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN.

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

Uso Público

Información de acceso público.

41. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE.

Tratándose de Derivados de Crédito cuya estructura contemple otro tipo de derivado, ya sea de Opción, Swap o Forward, en este campo se deberá reportar el “número de identificación” de dicho derivado que fue informado en el formulario “OPTO”, “SWAPS” u “OFF” respectivamente. Por ejemplo, tratándose de Derivados de Rendimiento Total, en este campo se deberá reportar el “número de identificación” del swap que fue informado en el formulario “SWAPS”. En el caso de Títulos con Vinculación Crediticia (clave “58” del campo 19), en este campo se deberá registrar la clave del título (o nota estructurada) correspondiente, como fue informado en el formulario “CVT”.

Tratándose de operaciones distintas a las anteriores, este campo debe reportarse “vacío”.

42. IDENTIFICADOR ÚNICO DEL PRODUCTO.

Si el Derivado de Crédito tiene asignado un “Identificador Único del Producto” deberá registrarse en este campo. En caso que la operación no tenga asignado dicho identificador, este campo deberá reportarse vacío.

43. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar un número para identificar a cada registro, el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la Institución internamente para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 5).

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

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

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

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

Uso Público

Información de acceso público.

Sección III, información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos.

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

Esta sección debe enviarse en la misma fecha de vencimiento anticipado, de cesión de derechos o de terminación (extinción), según corresponda, de la operación de que se trate. En caso que en algún día hábil bancario no exista al menos un evento de vencimiento anticipado, cesión de derechos o terminación de operaciones, se deberá reportar un archivo “vacío” en esta sección.

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

3. FECHA DE CONCERTACIÓN.

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

4. FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO.

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

5. FECHA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA.

Se deberá anotar la fecha efectiva en la que se liquidó el importe correspondiente al vencimiento anticipado o la cesión de derechos, con formato AAAA/MM/DD. En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, este campo debe reportarse “vacío”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

6. FORMA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA.

Se deberá anotar:

- S Cuando la operación se haya liquidado (anticipadamente) mediante entrega del activo de referencia.
- D Cuando la operación se haya liquidado (anticipadamente) “por diferencias”.
- N Cuando la operación se haya vencido anticipadamente (en forma total o parcial) o terminado (extinguido) sin obligación de liquidación.

7. IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS.

En su caso, se debe anotar el importe efectivamente pagado o recibido por el vencimiento anticipado, o cesión de derechos, de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato. En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción), el vencimiento anticipado o cesión de derechos, de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, se debe anotar “0” (cero).

Tratándose de operaciones con liquidación por entrega física (campo 6 igual a “S”), se debe anotar el valor de mercado del activo de referencia a la fecha de entrega.

8. MONEDA DEL IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS.

Se deberá anotar la clave de la moneda en la que está denominado el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción), el vencimiento anticipado o cesión de derechos, de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, se debe anotar “0” (cero).

9. IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO PARCIAL.

En su caso, se deberá anotar el importe vencido anticipadamente (en la fecha señalada en el campo 4) en forma parcial (“VP” en el campo 12) de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

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

10. LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS.

Se deberá anotar:

Uso Público

Información de acceso público.

R Cuando la Institución haya recibido el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos.

P Cuando la Institución haya pagado el importe por vencimiento anticipado, o cesión de derechos.

N Cuando la Institución no haya recibido ni pagado por la terminación (o extinción) o vencimiento (total o parcial) anticipado de la operación.

11. MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS.

Se deberá anotar la clave que corresponda al motivo del vencimiento anticipado, o de la cesión de derechos, de la operación, conforme al “Catálogo de Motivo del Vencimiento Anticipado, o de la Cesión de Derechos”, a que se refiere el Anexo R.

12. INDICADOR DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS.

Se deberá anotar:

- | | |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| VT | Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma total. |
| VP | Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial. |
| EX | Cuando la operación se haya terminado o extinguido anticipadamente (por ejemplo, cuando alguna cláusula de terminación o extinción de la operación se haya activado). |
| CD | Cuando los derechos de la operación se hayan cedido. |

En caso que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en este campo), debido a la re-negociación o re-estructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 11), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación, en la sección II de este formulario, considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado total de que se trate.

Por su parte, en el evento que los derechos de una determinada operación sean cedidos, se deberá anotar “CD” en este campo, y la clave “5” en el campo 11.

13. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN (ORIGINAL).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

14. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN.

En caso que una determinada operación fuera vencida anticipadamente en forma total (“VT” en el campo 12), debido a la re-negociación o re-estructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 11), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación en la sección II de este formulario, considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado total de que se trate. En este campo, se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de dicha nueva operación, tal cual fue informada al Banco de México en la sección correspondiente.

En el caso de operaciones que contemplen la terminación (o extinción) de las mismas, sin la obligación de liquidación de las partes, o de vencimientos anticipados en forma parcial o total (distintos a los mencionados anteriormente), este campo debe reportarse “vacío”.

15. IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN ORIGINAL.

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

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

16. IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN NUEVO.

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

Para los vencimientos anticipados, parciales o totales, distintos a los mencionados anteriormente, este campo debe reportarse “vacío”.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Sección IV, información de la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones celebradas, tanto en mercados reconocidos, como no reconocidos.

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

Esta sección debe reportarse en la misma fecha de ocurrencia del evento crediticio relativo a la operación (tanto bursátil como extra-bursátil) de que se trate. En caso que en algún día hábil no exista al menos una operación con materialización de algún evento crediticio, se deberá reportar un archivo “vacío” en esta sección.

Una vez que la institución reporte esta sección para una fecha en particular, Banco de México entenderá que las operaciones que no fueron reportadas en el SAIF-Web, y que llegaron a su vencimiento precisamente en esa fecha, no presentaron la ocurrencia de alguno de los eventos crediticios respectivos.

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

3. FECHA DE CONCERTACIÓN.

Se deberá anotar la fecha de concertación (original) de la operación (campo 4) cuya PROTECCIÓN fue ejecutada, con formato AAAA/MM/DD.

4. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar la clave de la sección (1 o 2) que corresponda a la operación cuya PROTECCIÓN fue ejecutada.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) original de la operación cuya PROTECCIÓN fue ejecutada. Este número (o clave) debe ser el mismo con el que se envió originalmente dicha operación en las secciones I o II de este formulario.

6. FECHA DE OCURRENCIA DEL EVENTO CREDITICIO.

Se deberá anotar la fecha de ocurrencia del evento crediticio que motivo la ejecución de la PROTECCIÓN relativa a la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

7. FECHA DE LIQUIDACIÓN DE LA PROTECCIÓN O PROTECCIÓN.

Se deberá anotar la fecha efectiva en la que se liquidó (o liquidará) el importe correspondiente a la ejecución de la PROTECCIÓN relativa a la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. FORMA DE LIQUIDACIÓN.

Se deberá anotar:

- S Cuando la operación se haya liquidado mediante entrega del activo de referencia.
- D Cuando la operación se haya liquidado “por diferencias”.

9. IMPORTE LIQUIDADO POR LA PROTECCIÓN.

En este campo se deberá anotar, el importe efectivamente pagado o recibido por la ocurrencia del evento crediticio relativo a la operación de que se trate, en miles (redondeado, con un decimal) de unidades de la moneda de liquidación de que se trate.

En particular, para las operaciones que se liquiden por entrega “física” del activo de referencia, este importe corresponde al efectivo liquidado por la ocurrencia del evento crediticio.

Por ejemplo, en el caso de una operación cuyo activo de referencia es un título de deuda, en este campo debe reportarse el importe efectivamente pagado o recibido por la ocurrencia del evento crediticio, independientemente del valor contable o de mercado de dicho título.

10. MONEDA DEL IMPORTE LIQUIDADO.

Se deberá anotar la clave de la moneda en la que está denominado el importe liquidado por la PROTECCIÓN (campo 9) en la operación de que se trate, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo “E”.

En el caso de operaciones cuya moneda de liquidación, por la ocurrencia del evento crediticio) sea la misma que la de liquidación (informada en la fecha de concertación correspondiente), se debe anotar “0” (cero), equivalente a No aplica.

11. VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA, EN LA FECHA DEL EVENTO CREDITICIO.

Uso Público

Información de acceso público.

Se deberá anotar el valor de mercado o contable del activo de referencia, relativo a la operación de que se trate, a la fecha de ocurrencia del evento crediticio de la operación de que se trate (campo 6), en miles (redondeado, con un decimal) de unidades de la moneda de denominación del activo de referencia correspondiente (informada, en su caso, en la sección II en la fecha de concertación correspondiente).

12. CLAVE DEL TÍTULO DE DEUDA, RECIBIDO O ENTREGADO, PARA LA LIQUIDACIÓN.

Tratándose de operaciones cuyo activo de liquidación sea diferente del activo de referencia (campo 24 de la sección II) y si dicho activo de liquidación es un título de deuda (claves “TDM” o “TDE”), una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX”), un índice accionario (claves “IAM” o “IAX”), o un título referenciado (claves “TRM” o “TRE”), se deberá anotar la “clave” que corresponda al título de deuda de que se trate, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio” a que se refiere el Anexo AF.

En el caso de operaciones cuyo activo de liquidación sea el mismo que el activo de referencia (campo 22 de la sección II), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

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

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme la obligatoriedad señalada en la regla 12.4 de la Circular 4/2012. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario de DC. Adicionalmente, si la operación corresponde a la Sección I, este campo deberá reportarse “vacío”.

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

Sección V, información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

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

3. FECHA DE CONCERTACIÓN.

Se deberá anotar la fecha de concertación (original) de la operación vigente al fin de mes a confirmar (campo 4), con formato AAAA/MM/DD.

4. FECHA DE CORTE.

Se deberá anotar la fecha de corte que corresponda a las operaciones vigentes a confirmar, con formato AAAA/MM/DD.

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de identificación (original) de la operación vigente al fin de mes a confirmar (campo 4).

6. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN.

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

7. IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos redondeado sin decimales) de la operación vigente a la fecha de corte (campo 4) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima o del costo de la protección) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

8. VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos redondeado sin decimales) del activo de referencia de la operación vigente a la fecha de corte (campo 4) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

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

En caso que el contrato relativo a la operación vigente considere el otorgamiento de garantías entre las partes, se deberá anotar la clave o folio de identificación para el activo o conjunto de éstos (portafolio) que constituyen la garantía de la operación de que se trate o conjunto de operaciones. Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”, el cual debe enviarse en forma previa a este formulario.

Sección VI, información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos

AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO

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

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar la clave asignada para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la Entidad Financiera Filial del Exterior, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

3. FECHA DE CONCERTACIÓN.

Se deberá anotar la fecha de concertación (original) de la operación vigente al fin de mes a confirmar (campo 4), con formato AAAA/MM/DD.

4. FECHA DE CORTE.

Se deberá anotar la fecha de corte que corresponda a las operaciones vigentes a confirmar, con formato AAAA/MM/DD.

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de identificación (original) de la operación vigente al fin de mes a confirmar (campo 4).

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

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, se deberá anotar la clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte de la misma “operación estructurada” o “paquete” con el mismo número de identificación del conjunto de operaciones que se haya reportado en el campo 20 de la Sección II.

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

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán las operaciones individuales que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”. Cada grupo de operaciones relativas a una determinada “operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

estructurada” o “paquete”, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1). Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más operaciones individuales que tengan la misma clave de institución (campo 1), fecha de concertación (campo 3) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 6).

8. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN.

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

9. IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA O DEL COSTO DE LA PROTECCIÓN.

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos redondeado sin decimales) de la operación vigente a la fecha de corte (campo 4) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima o del costo de la protección) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

En caso que las operaciones formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (campo 6 distinto de “NA”), se deberá anotar el valor de este campo en el registro correspondiente al consecutivo uno (campo 7 igual a “1”).

10. VALOR DEL ACTIVO DE REFERENCIA.

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos redondeado sin decimales) del activo de referencia de la operación vigente a la fecha de corte (campo 4) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

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

En caso que el contrato relativo a la operación vigente considere el otorgamiento de garantías entre las partes, se deberá anotar la clave o folio de identificación para el activo o conjunto de éstos (portafolio) que constituyen la garantía de la operación de que se trate o conjunto de operaciones. Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la sección II del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”, el cual debe enviarse en forma previa a este formulario.

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

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

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

Validaciones de negocio para cada campo del formulario que se realizarán en el Saif-web

Sección I, relativa a las operaciones celebradas en mercados reconocidos (bursátiles).

A. Validaciones registro por registro.

1. Clave de la Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”). Adicionalmente, el Código LEI, reportado en este campo deberá estar vigente a la fecha de celebración de la Operación Derivada.

3. Oficina que realiza la operación.

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

4. Mercado.

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

5. Fecha de Concertación.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente esta fecha debe ser mayor o igual a la “Fecha de inicio de cotización” y menor o igual a la “Fecha de vencimiento”, conforme a los campos respectivos del Anexo AA, que correspondan a la pizarra registrada en el campo 7.

6. Posición en la Protección.

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

7. Clave de Pizarra.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “pizarra” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo “AA”. Asimismo, el mercado asociado

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

a la pizarra (campo “Mercado” del Anexo “AA”) debe ser idéntico al registrado en el campo 4. Adicionalmente, el campo “DC1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra, debe ser igual a “1”.

8. Objetivo de la Operación.

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

9. Número de Contratos.

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

10. Importe de la prima o del costo de la protección.

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

11. Moneda en que está expresada la prima o el costo de la protección.

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

12. Número de Identificación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 5).

13. Socio liquidador de la operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo O, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser idéntico a la clave registrada en el campo 4.

14. Operador de la operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “Operador o Facilitador” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P.

Adicionalmente, el campo “Mercado” del Anexo P, que corresponda a la entidad registrada, deberá ser idéntico a la clave registrada en el campo 4; excepto cuando la clave de este campo sea igual a “076000” (equivalente a no aplica).

15. Cámara de compensación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cámaras de Compensación” a que se refiere el Anexo L. Adicionalmente, la columna “Mercado” del Anexo L, que corresponda a la cámara de compensación, debe ser idéntico a la clave registrada en el campo 4.

Uso Público

Información de acceso público.

Sección II, relativa a las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.

A. Validaciones registro por registro

1. Clave de la Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

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

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

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

Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”)

3. Oficina que realiza la operación.

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

4. Clave de la Contraparte.

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

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

5. Fecha de Concertación.

Este campo no podrá reportarse vacío. Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

6. Fecha de Inicio.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe ser igual o mayor al campo 5.

7. Fecha de Vencimiento.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de concertación (campo 5) en al menos dos días hábiles bancarios (Conforme al calendario de días inhábiles que publique la CNBV, cuando la contraparte del campo 4 sea residente en México, lo cual implica que la columna "clave_tipo_residencia" del "Anexo B" sea igual a "N" para la contraparte respectiva, o conforme al calendario de días inhábiles de los E.U.A., en caso que la contraparte sea residente en el extranjero, lo cual implica que la columna "clave_tipo_residencia" del "Anexo B" sea igual a "E" para la contraparte respectiva).

Asimismo, si la fecha registrada en este campo es mayor que la fecha de concertación (campo 5) a lo más en dos días hábiles bancarios (conforme al calendario de días inhábiles que publique la CNBV, cuando la contraparte del campo 4 sea residente en México, lo cual implica que la columna "clave_tipo_residencia" del "Anexo B" sea igual a "N" para la contraparte respectiva, o conforme al calendario de días inhábiles de los E.U.A., en caso que la contraparte sea residente en el extranjero, lo cual implica que la columna "clave_tipo_residencia" del "Anexo B" sea igual a "E" para la contraparte respectiva) se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: "Favor de verificar la fecha de vencimiento conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente".

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

Esta fecha puede ser un día inhábil bancario (ya sea en México o en el extranjero); sin embargo, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: "Favor de verificar la fecha de vencimiento conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente".

Si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a alguna de las claves siguientes: "TDM", "TDE", "TRM", "TRE", "CDM", "CDE", "CTE", "CTM", "IAM", "IAX", "G01" o "I99", se deberá hacer un cruce del campo "24.Clave del título de deuda de referencia" con la columna "clave" comprendido en el "Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio"

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

a que se refiere el Anexo AF, y este campo (campo 7) deberá ser menor o igual al valor de la columna "fe_ven" que corresponda a dicho cruce.

Si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a alguna de las claves siguientes: "PCM" o "PCE", el valor de este campo deberá ser menor o igual al campo "27.Fecha de Vencimiento del Activo de Referencia".

Finalmente, la fecha registrada debe ser mayor a la "Fecha de inicio del periodo de protección" (campo 6).

8. Número de Días Hábiles para Liquidar la Operación.

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

No obstante, en caso que para una operación en particular el Número de Días Hábiles para Liquidar la Operación fuera mayor a ocho, podrá modificarse la tolerancia de esta validación en el sistema de acopio para el acopio de dichas operaciones, incluyendo para ello los campos llaves de dicha operación en el catálogo de "Apertura de Días Hábiles para Liquidar la Operación".

9. Posición en la Operación.

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

10. Objetivo de la Operación.

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

11. Importe de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual o mayor que cero (0).

Este campo no podrá ser igual a cero (0) si el campo "13.- Tasa de Recuperación Aplicable al Activo de Referencia" es igual a cero (0).

Finalmente, este campo no podrá ser igual a cero (0) si el campo "19.-La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete" " es igual a las claves "56", "62" y "63".

12. Moneda del Importe de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E. Si el campo "11.- Importe de la Protección" es mayor a cero, la clave registrada en este campo debe ser distinta de la clave "0". Si el campo "11.- Importe de la Protección" es igual a cero (0), la clave registrada en este campo debe ser igual de la clave "0".

13. Tasa de Recuperación Aplicable al Activo de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá estar mayor que cero (0.00) y menor o igual a cien (100.00).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

En caso de que el valor de este campo sea igual a "100.00" (cien) y el campo "11. Importe de la Protección" sea igual a "0" (0.00), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: "Favor de verificar el Porcentaje de recuperación aplicable al activo de referencia, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente".

14. Importe de la Prima (Total).

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que "0" (cero). Sin embargo, si el campo "19.- la Operación es Parte de una 'Operación Estructurada' o 'Paquete'" es distinto a "57", "58" o "59"; entonces este campo debe ser mayor a "0" (cero).

15. Moneda del Importe de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E. Si el campo "14.- Importe de la Prima (Total)" es mayor a cero, la clave registrada en este campo debe ser distinta de la clave "0". Si el campo "14.- Importe de la Prima (Total)" es igual a cero (0), la clave registrada en este campo debe ser igual de la clave "0".

16. Frecuencia de la Prima o del Costo de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Frecuencia de la prima o del costo de la protección" a que se refiere el Anexo AP.

17. Día Natural del Pago de la Prima o del Costo de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá estar entre "0" (cero) y "31" (treinta y uno).

En caso de que el campo "16- Frecuencia de la Prima o del Costo de la Protección" sea igual a "U", este campo deberá ser igual a "0" (cero)

En caso de que el campo "16- Frecuencia de la Prima o del Costo de la Protección" sea diferente a "U", este campo deberá ser mayor a "0" (cero).

18. Fecha de Pago/Cobro de la Prima o del Costo de la Protección.

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo "14- Importe de la Prima o del Costo de la Protección" sea igual a "0" (cero), este campo debe reportarse vacío. Si el campo "14- Importe de la Prima o del Costo de la Protección" es distinto a "0" (cero), este campo no deberá reportarse vacío.

En caso de que este campo sea distinto a vacío, su valor deberá ser mayor o igual al campo "5-Fecha de Concertación" y menor o igual a al campo "7-Fecha de Vencimiento".

Sin embargo, si el valor de este campo es igual al campo "7-Fecha de Vencimiento" se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: "Favor de verificar la fecha de pago/cobro de la prima conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente".

Uso Público

Información de acceso público.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Anexo “J”, y tener “1” (uno) en la columna “dc2”.

Si el campo "11. Importe de la protección" es mayor a “0” (cero), este campo deberá ser igual a las claves “56”, “62” y “63”.

Si el campo "11. Importe de la protección" es igual a “0” (cero), este campo deberá ser diferente a la clave “56”, “62” y “63”.

Si el campo "16. Frecuencia de la prima o del costo de la protección" es diferente de "U", este campo podrá ser igual a las claves “55”, “56”, “57”, “58” y “59”.

Si el campo "16. Frecuencia de la prima o del costo de la protección" es igual a "U", este campo podrá ser igual a las claves “60”, “61”, “62”, “63”, “64”, “65”, “66” y “67”.

Si el campo "28. Precio unitario o tasa de ejercicio" es mayor a "0" (cero), este campo podrá ser igual a las claves 60”, “61”, “62”, “63”, “64”, “65”, “66” y “67”.

Finalmente, si el campo "29. Precio unitario o tasa de ejercicio dos" es mayor a "0" (cero), este campo podrá ser igual a las claves “64”, “65”, “66” y “67”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando la clave del campo “19- La operación es parte de una operación estructurada o paquete” sea distinta de “90”, en este campo debe registrarse una clave distinta de “NA”.

En caso que el campo “19- La operación es parte de una operación estructurada o paquete” sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío.

Cuando el campo “19-La operación es parte de una operación estructurada o paquete” sea distinto de “90”, el valor numérico de este campo debe iniciar en uno (1), y continuar en forma secuencial (1, 2, 3, etc.) para los registros que tengan la misma clave o folio en el campo “19 Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”. Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 5) y la misma “Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo “paquete” o “estrategia” (campo 19).

Uso Público

Información de acceso público.

En caso que el campo 19 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a “90” (y por tanto, el campo 19 sea igual a “NA”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

En caso que el campo "19 .La operación es parte de una operación estructurada o paquete” sea igual a las claves, “60”, “61”, “62” o “63”; se deberán tener como mínimo dos registros cuyos campos llave sean iguales ("Clave de la institución" (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 5) y, "Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’" (campo 20)); es decir, debe existir un registro con valor de este campo igual a 1 y otro registro con valor de este campo igual a 2, ambos con las mismas llaves mencionadas anteriormente.

22. Tipo de subyacente (Activo de Referencia).

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F. Adicionalmente, el campo “DC2” del Anexo F, que corresponda al tipo de subyacente, debe ser igual a “1”.

23. Emisora o deudora del activo de referencia.

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que la clave del campo 22 corresponda a préstamos o créditos (claves “PCM” o “PCE” en el campo 22) este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el Anexo B.

24. Clave del Título de Deuda de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío.

En caso que la clave del campo 22 corresponda a un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 22), un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 22), una canasta de acciones (clave “G01” en el campo 22), canasta de bonos (claves “CDM” o “CDE” en el campo 22), préstamos o créditos (claves “PCM” o “PCE” en el campo 22) o un título referenciado a acciones (claves “TRM” o “TRE” en el campo 22) este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser distinto de “NA” (No aplica). Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF. Asimismo, la “Clase Subyacente” (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntica al valor de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo “22-Tipo de Subyacente (Activo de Referencia)”.

Asimismo, si la clave del campo 22 (“Tipo de Subyacente”) es igual a alguna de las claves siguientes: “ACM”, “ACE”, “TDM”, “TDE”, “G01”, “CDM”, “CDE”, “PCM”, “PCE”, “TRM” o “TRE”, entonces dicha clave debe ser igual al “Tipo de Subyacente” (columna “suby” del Anexo AF) que corresponda a la clave registrada en este campo.

Si la clave del campo 22 es distinta de las siguientes claves: “ACM”, “ACE”, “TDM”, “TDE”, “G01”, “CDM”, “CDE”, “PCM”, “PCE”, “TRM” o “TRE” este campo debe ser igual a “NA” (No aplica); sin embargo, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar el tipo de subyacente y clave del título de deuda o activo de referencia conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

25. Importe del Activo de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual o mayor que cero (0).

En caso que la clave del campo 22 corresponda a un título de deuda (claves "TDM" o "TDE" en el campo 22), un título representativo de capital (claves "ACM" o "ACE" en el campo 22), una canasta de acciones (clave "G01" en el campo 22), canasta de bonos (claves "CDM" o "CDE" en el campo 22), préstamos o créditos (claves "PCM" o "CDE" en el campo 22) o un título referenciado a acciones (claves "TRM" o "TRE" en el campo 22) este campo no deberá ser igual a cero (0).

26. Moneda en que está Expresado el Importe del Activo de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E. Si el campo "24.- Importe del Activo de Referencia" es mayor a cero, la clave registrada en este campo debe ser distinta de la clave "0". Si el campo "25.- Importe del Activo de Referencia" es igual a cero (0), la clave registrada en este campo debe ser igual de la clave "0".

27. Fecha de Vencimiento del Activo de Referencia.

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que la clave del campo 22 corresponda a préstamos o créditos (claves "PCM" o "PCE" en el campo 22) este campo no podrá reportarse vacío.

28. Precio unitario o tasa de ejercicio.

Este campo podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que "0" (cero).

En particular, si el campo "19-La operación es parte de una Operación Estructurada o Paquete" es igual de la clave "60" a la "67", entonces este campo debe ser mayor a "0" (cero).

29. Precio unitario o tasa de ejercicio dos.

Este campo podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que "0" (cero).

30. Tipo de evento crediticio de la operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Tipos de Eventos Crediticios" a que se refiere el Anexo AK o sus combinaciones.

Si el campo "19. La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete" es igual a 64 o 65, entonces este campo deberá ser igual a la clave "6".

Si el campo "19. La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete" es igual a 66 o 67, entonces este campo deberá ser igual a la clave "5".

Finalmente, si el campo "31. Número de Activo de Referencia en Incumplimiento para activarse la protección" es mayor a 1 (uno), entonces este campo deberá ser igual a la clave "7" u "8".

31. Número de Activo de Referencia en Incumplimiento para activarse la protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá estar entre uno (1) y diez (10).

Si el campo "30. Tipo de evento crediticio de la operación" es igual a la clave "7" u "8", entonces este campo deberá ser mayor a "1" (uno).

Uso Público

Información de acceso público.

32. Forma de Pago del o los Activos de Referencia en Default (para Canastas).

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves "0", "1" o "2", según sea el caso.

Si el campo "30. Tipo de evento crediticio de la operación" es igual a la clave "7" u "8", entonces este campo deberá ser distinto al valor "0" (cero).

33. Modalidad de Liquidación, en caso del Evento Crediticio.

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves "S", "D" o "M", según sea el caso.

34. Tipo de Producto Derivado.

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, la clave que se anote debe estar comprendida en el Anexo "C", y tener "1" (uno) en la columna "dc2".

a) La clave de este campo debe ser igual a "68", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "TIM" o "TIX".

b) Este campo debe ser igual a "69", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "TDE" o "TDM".

c) Este campo debe ser igual a "56", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "ACE" o "ACM".

d) Este campo debe ser igual a "58", si el campo 24 ("Tipo de Subyacente") es igual a la clave "G01".

e) Este campo debe ser igual a "62" o "63", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "IAM" o "IAX".

f) Este campo Debe ser igual a "58", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a la clave "I99".

h) Este campo debe ser igual a "70", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "TRE" o "TRM".

i) Este campo debe ser igual a "65", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a las claves "SWP" o "FWD".

j) Este campo Debe ser igual a "59", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a la clave "CTE".

k) Este campo Debe ser igual a "71", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a la clave "CDM".

l) Este campo Debe ser igual a "72", si el campo 22 ("Tipo de Subyacente") es igual a la clave "CDE".

35. Plataforma de Negociación.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Sociedades que administran Sistemas para concertar Operaciones" a que se refiere el Anexo K.

36. Socio liquidador de la operación.**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

37. Cámara de Compensación.

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

Asimismo, si el campo “36- Socio Liquidador de la Operación” es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual a “90”.

38. Agente de Cálculo y Liquidación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se registre debe estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes”, a que se refiere el Anexo B, incluyendo la clave “000111”.

En caso que el campo “37-Cámara de Compensación o Repositorio de Derivados” sea igual a “90”, entonces la clave de este campo debe ser igual a: i) el campo 1 (“Clave de Institución”), ii) el campo 4 (“Clave de la Contraparte”), o iii) la clave “000111”.

Si el campo “37-Cámara de Compensación o Repositorio de Derivados” es distinto de “90”, entonces la clave de este campo debe estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes”, a que se refiere el Anexo B, incluyendo la clave “000111”.

39. Repositorio de Derivados.

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

Asimismo, si el campo “37- Cámara de Compensación” es distinto a “90”, entonces este campo debe ser distinto a “90”. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que una operación no cumpla con lo anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar que la operación no fue registrada en un Repositorio de Derivados.”.

40. Clave de confirmación de la operación.

Este campo no podrá reportarse vacío.

41. Número de identificación de la operación derivada subyacente.

En caso que el campo “19- La operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’” sea igual a la clave “55”, “56” o “57” este campo no debe reportarse vacío y ser distinto de “NA”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

42. Identificador Único del Producto.

Este campo podrá reportarse vacío.

43. Número de identificación de la operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar un número para identificar a cada registro el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 5).

44. Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)

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

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

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

A. Validaciones registro por registro

Las operaciones que la institución envíe en la Sección III (en su respectiva fecha de vencimiento anticipado, cesión de derechos o terminación o extinción) deben haber sido enviadas previamente en la Sección II, en su fecha de concertación correspondiente.

1. Clave de la Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 (“Clave de la Institución”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 5) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 41).

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

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

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

Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

3. Fecha de Concertación.

Este campo no podrá reportarse vacío.

4. Fecha de Vencimiento Anticipado.

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser mayor que la “Fecha de concertación” (campo 3). La fecha que se reporte puede ser un día inhábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

Adicionalmente, la fecha de este campo debe ser menor que la “Fecha de Vencimiento del Período de Protección” (campo 7 de la Sección II) de la operación que tenga los mismos campos “llave” en la Sección II.

5. Fecha de Liquidación Anticipada.

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que este campo sea no vacío, la fecha registrada debe ser igual o mayor que la “Fecha de vencimiento anticipado” (campo 4). Asimismo, esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

6. Forma de Liquidación Anticipada.

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S”, “D” o “N”. Este campo deberá ser igual a “N” si el valor del campo "10- La institución pagó o recibió el importe del vencimiento anticipado o cesión de derechos" es igual a "N".

7. Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos.

Este campo no podrá reportarse vacío.

Su valor numérico debe ser mayor o igual que uno (1), si el campo 10 (“La institución pago o recibió el importe del vencimiento anticipado o cesión de derechos”) es igual a “P” o “R”.

Debe ser distinto a cero (“0”), si el campo “6- Forma de Liquidación Anticipada” es igual a “S”.

Debe ser igual a cero (“0”), si el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “EX”.

Debe ser igual a cero (“0”), si el campo 10 (“La institución pago o recibió el importe del vencimiento anticipado o cesión de derechos) es igual a “N”.

El valor de éste campo debe ser menor o igual al campo “11-Importe de la Protección” del registro de la Sección 2, que tenga los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”) que el registro de esta Sección III, para esta validación los importes se compararán en la misma moneda. En caso de que el importe de este campo sea mayor a dicho campo 11, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “El Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos de la operación es superior al importe base o de referencia (Campo 11) del registro de la Sección 2, que tiene los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”); favor de verificar. En caso de que sea correcto, favor de enviar la documentación relativa al correo electrónico derivados@banxico.org.mx” para

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

modificar la tolerancia de esta validación en el sistema de acopio para el acopio de dicho vencimiento.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo “7-Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos” sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el campo “7-Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos” es mayor que “0” (cero), la clave de este campo debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero), “102”, “979” y “990”.

9. Importe por vencimiento anticipado parcial.

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea distinto de “VP”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “VP”, este campo debe ser mayor que “0” (cero).

Se deberá buscar en la base de datos de la sección III si ya existe algún registro que contenga los mismos tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta misma sección III y que en el campo 12 contenga la clave “VT”, “EX” o “CD”; en tal caso, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “Este registro ya fue reportado anteriormente en esta sección con la clave “VT”, “EX” o “CD”, por lo que no se puede reportar una vez más”.

En caso de que no exista ningún registro con las características anteriores, se realizarán las siguientes validaciones: Si el campo 12 es igual a “VP”, el valor numérico de este campo 9 debe ser mayor que el campo 7, para esta validación los importes se compararán en la misma moneda.

Asimismo, cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo “11-Importe de la Protección” del registro de la Sección II, que tenga los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”) que el registro de esta sección III, para esta validación los importes se compararán en la misma moneda. Adicionalmente, cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” y en caso que en la base de datos de la sección III existan dos o más registros que tengan los mismos tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta sección III y que en el campo 12 también tengan la clave “VP”, entonces se debe sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo “9- Importe por vencimiento anticipado parcial” de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo “11-Importe de la Protección” de la Sección II conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). Además, si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente por un monto igual a la resta entre el campo “11-Importe de la Protección” y su correspondiente sumatoria de vencimientos parciales (“VP”) entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 12).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

10. La institución pagó o recibió el importe del vencimiento anticipado o cesión de derechos.

Este campo no podrá reportarse vacío.

Si el campo "12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos" es igual a "EX", entonces este campo debe ser igual a "N".

Si el campo "12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos" es distinto de "EX", este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes: "R" "P" o "N".

11. Motivo del vencimiento anticipado o cesión de derechos.

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Motivo de la Vencimiento anticipado", a que se refiere el Anexo R.

Adicionalmente, si el campo "12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos" es igual a "CD", entonces este campo debe ser igual a "5".

Si el valor de este campo es igual a "7", entonces deberá existir un registro de la Sección 2, que tenga los siguientes campos "llave": la misma "Clave de Institución" (Campo 1), "5.-Fecha de Concertación" igual al campo "4.- Fecha de Vencimiento Anticipado" (de esta sección III) y "41.- Número de Identificación de la Operación" igual al campo "14.- Número de Identificación de la Nueva Operación" (de esta sección IV).

12. Indicador de vencimiento anticipado o cesión de derechos.

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves "VT", "VP" "CD" o "EX".

Si el valor del campo 12 es distinto de la clave a "VP", entonces a través de los tres campos "llave" (campo 1 "clave de la institución", campo 3 "fecha de concertación" y campo 13 "número de identificación de la operación (original)"), se deberá buscar si dentro de la base de datos de la Sección III exista un registro que tenga los mismos tres campos "llave" que el registro que se está reportando en esta sección y que en el campo 12 sea igual a la clave "VT", "EX" o "CD", si esto sucede, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: "Este registro ya fue reportado anteriormente en esta sección con la clave "VT", EX" o "CD", por lo que no se puede reportar una vez más".

Si el valor del campo 12 es igual a la clave "VP", se deberá buscar dentro de la base de datos de la Sección III si existe algún registro que tenga los mismos tres campos "llave" (campo 1 "clave de la institución", campo 3 "fecha de concertación" y campo 13 "número de identificación de la operación (original)"), que el registro que se está reportando en esta misma sección cuyo campo 12 sea igual a la clave "VT", "EX" o "CD" y cuyo valor del campo "5-Fecha de Vencimiento Anticipado" de dicho registro sea menor al valor del campo 5 que se está reportando en esta sección, si esto sucede, entonces se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: "Este registro ya fue reportado

Uso Público

Información de acceso público.

anteriormente en esta sección con la clave “VT”, “EX” o “CD”, por lo que no se puede reportar un vencimiento anticipado parcial (VP)”.

Si el valor del campo 12 es igual a la clave “VP”, se deberá buscar dentro de la base de datos de la Sección III si existe algún registro que tenga los mismos tres campos “llave” (campo 1 “clave de la institución”, campo 3 “fecha de concertación” y campo 13 “número de identificación de la operación (original)”) cuyo campo 5 “Fecha de Vencimiento Anticipado” sea igual al campo 5 que se está reportando en esta misma sección, si esto sucede, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “Este registro ya ha sido vencido parcialmente para la misma fecha de vencimiento”.

Asimismo, cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo “11-Importe de la Protección” del registro de la Sección II, que tenga los mismos campos “llave” (es decir, la misma “Clave de Institución”, “Fecha de Concertación” y “Número de Identificación de la Operación”) que el registro de esta Sección III. Adicionalmente, cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” y en caso que en la base de datos de la Sección III existan dos o más registros que tengan los mismos tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta Sección III cuyo campo 12 también tengan la clave “VP”, entonces se deberá sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo “9- Importe por vencimiento anticipado parcial” de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo “11-Importe de la Protección” de la Sección II conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). Además, si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente de manera parcial (valor igual a “VP” en el campo 12) por un monto igual a la resta entre el campo “12-Importe Base o de Referencia” y su correspondiente sumatoria de vencimientos parciales (“VP”), entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (valor igual a “VT” en el campo 12).

13. Número de Identificación de la Operación (Original).

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 5 para la sección II). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección III, con los correspondientes de la Sección II.

14. Número de Identificación de la Nueva Operación.

Este campo podrá reportarse vacío.

Este campo debe reportarse vacío cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP”, “CD” o “EX”.

También debe ser vacío cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VT” y el campo “11-Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea distinto de “7”.

Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VT” y el campo “11-Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “7”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

15. Identificador Único de Transacción Original

Este campo no podrá reportarse vacío, para la información a partir del primero de diciembre de 2023. Se deberá anotar el mismo identificador que el registrado para la operación original (enviada en la Sección II, sección a la que corresponde la operación), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 3) y número de identificación de la operación (campo 13).

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

16. Identificador Único de Transacción Nuevo

Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 12 sea igual a "EX" o "VP". Asimismo, debe ser vacío cuando el campo 12 sea igual a "VT" y el campo 11 sea distinto "7". Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 12 sea igual a "VT" y el campo 11 sea igual a "7". En caso de que el campo 12 sea igual a "CD", este campo puede ser vacío.

Por otro lado, el identificador que se registre en este campo deberá encontrarse en la Sección II, de acuerdo a los campos: institución, fecha de vencimiento anticipado (campo 4), número de identificación de la nueva operación (campo 14).

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

En caso que el valor del campo "14-Número de Identificación de la Nueva Operación" es distinto de vacío, este campo no debe ser vacío. De igual forma, si el valor de este campo es distinto de vacío, el valor del campo "14-Número de Identificación de la Nueva Operación" no debe ser vacío.

Sección IV, relativa a la información de la ocurrencia de eventos crediticios que activaron la protección de operaciones celebradas, tanto en mercados reconocidos, como no reconocidos.

A. Validaciones registro por registro.

Las operaciones que la institución envíe en la sección IV (en su respectiva fecha de ocurrencia) deben haber sido enviadas previamente en la Sección I o II según corresponda, en su fecha de concertación correspondiente.

1. Clave de la Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al "Catálogo de Instituciones" incorporado al SAIF-Web.

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 ("Clave de la Institución") de la Sección I o II para la operación que tenga los mismos campos "llave"; es decir, la misma "Clave de Institución" (campo 1), "Fecha de concertación" (campo 5) y "Número de Identificación de la Operación" (campo 12 para Sección I y campo 41 para Sección II).

2. Código LEI (Denominado en inglés como "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") de la institución.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

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

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

Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”)

3. Fecha de Concertación.

Este campo no podrá reportarse vacío.

4. Sección a la que corresponde la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual exclusivamente a las claves “1”, o “2”. En caso que el registro de esta sección sea igual a “1” o “2”, la operación que se debe relacionar (conforme a los tres campos “llave”) debe estar en la base de datos transaccional de la sección “I” o “II”, según corresponda.

5. Número de Identificación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar el mismo número o clave que el registrado para la operación original (secciones I o, II), sobre la base que un mismo número de identificación no se puede asignar a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 3). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección IV, con los correspondientes de las secciones I o II.

6. Fecha de Ocurrencia del Evento Crediticio.

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser mayor que la “Fecha de concertación” (campo 3).

Adicionalmente, la fecha de este campo debe ser menor o igual que la “Fecha de Vencimiento del Período de Protección” (campo 7 de la sección II) de la operación que tenga los mismos campos “llave” en la sección II, si el campo “4- Sección a la que corresponde la Operación” es igual a “2” (dos).

7. Fecha de Liquidación de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, la fecha de este campo debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero), y ser mayor que la “Fecha de concertación” (campo 3), adicionalmente, este campo debe ser mayor o igual que la “Fecha de Ocurrencia del Evento Crediticio” (campo7).

Asimismo, si el campo "3.- Sección a la que corresponde la Operación" es igual a "2", entonces la fecha de este campo no debe ser mayor a la “Fecha de Vencimiento del Período de Protección” (campo 7 de la sección II) de la operación que tenga los mismos campos “llave” en la sección II en de más siete días.

8. Modalidad de Liquidación, en Caso del Evento Crediticio.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves "S" o "D".

9. Importe Liquidado por la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que "0" (cero).

10. Moneda del Importe Liquidado.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de este campo debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de "0" (cero), "102", "979" y "990".

11. Valor del Activo de Referencia, en la Fecha del Evento Crediticio.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que "0" (cero).

12. Clave del Título de deuda, Recibido o Entregado, para la liquidación.

Este campo no podrá reportarse vacío, si su valor es diferente de "NA" (No aplica), este valor deberá estar comprendido en el "Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio" a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, si el valor este campo es diferente de "NA" (No aplica), este campo deberá ser diferente del valor reportado en el campo 24 de la sección II.

13. Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como "Unique Transaction Identifier")

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del primero de diciembre de 2023. Se deberá anotar el mismo identificador que el registrado para la operación original (enviada en la Sección II), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 3) y número de identificación de la operación (campo 5). Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 4) es igual a 1, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

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

Sección V, relativa a la información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos.

A. Validaciones registro por registro.

Los registros que la institución reporte en esta Sección V deben corresponder (conforme a sus campos "llave") uno a uno con los registros de la sección I enviados a convalidar por personal de la Oficina de Información de Derivados, para la fecha de corte que corresponda.

1. Clave de la Institución.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 (“Clave de la Institución”) de los registros de la Sección I enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de Corte” (campo 4), “Fecha de Concertación” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

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

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

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

Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”)

3. Fecha de Concertación.

Este campo no podrá reportarse vacío.

4. Fecha de Corte.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe estar comprendida en el catálogo de “Fechas de Corte para Convalidación”, y ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a convalidar de que se trate.

Asimismo, este campo es uno de los cuatros campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

5. Número de Identificación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Concertación” (campo 3).

Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes de la Sección I enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

6. Objetivo de la Operación.

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

7. Importe Actualizado (Mercado) de la Prima (Total) o del Costo de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

8. Valor del Activo de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que “0” (cero).

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

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

Si la clave o folio es distinta a “SG”, ésta deberá estar incluida (conforme los campos “llave”: institución y fecha de corte) en el campo 6 de alguno de los registros de la Sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”. Sin embargo, en caso de que exista un contrato de garantía y aún no se haya entregado o recibido activos en garantía, deberá comunicarse a “derivados@banxico.org.mx”.

Sección VI, relativa a la información sobre la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.

A. Validaciones registro por registro.

Los registros que la institución reporte en esta Sección VI deben corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con los registros de la Sección II enviados a convalidar por personal de la Oficina de Información de Derivados, para la fecha de corte que corresponda.

1. Clave de la Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1 (“Clave de la Institución”) de los registros de la Sección II enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de Corte” (campo 4), “Fecha de Concertación” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

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

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

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

Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el correspondiente al valor del Código “LEI” de la institución indicada en el campo 1. (“Clave de la institución”)

3. Fecha de Concertación.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

Este campo no podrá reportarse vacío.

4. Fecha de Corte.

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe estar comprendida en el catálogo de “Fechas de Corte para Convalidación”, y ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a convalidar de que se trate.

5. Número de Identificación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Concertación” (campo 3).

Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes de la Sección II enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

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

Este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, el valor de este campo deberá estar relacionado con los registros correspondientes de la Sección II enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

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

Este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, el valor de este campo, junto con el campo 6, deberá estar relacionado con los registros correspondientes de la Sección II enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

8. Objetivo de la Operación.

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

9. Importe Actualizado (Mercado) de la Prima (Total) o del Costo de la Protección.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que “0” (cero).

Si el campo “6- Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’” es igual a “NA” o si el campo “7- Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’” es igual a “1”, el valor de este campo debe ser mayor a “0” (cero); en cualquier otro caso, debe ser igual a cero.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).

10. Valor del Activo de Referencia.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que “0” (cero).

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

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

Si la clave o folio es distinta a “SG”, ésta deberá estar incluida (conforme los campos “llave”: institución y fecha de corte) en el campo 5 de alguno de los registros de la Sección II del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”. Sin embargo, en caso de que exista un contrato de garantía y aún no se haya entregado o recibido activos en garantía, deberá comunicarse a derivados@banxico.org.mx.

Adicionalmente, la contraparte (campo 4) de los registros que corresponden a las operaciones vigentes enviados a convalidar a través del SAIF-Web deberá estar incluida en alguno de los registros de la Sección IV del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

12. Identificador Único de Transacción (denominado en inglés como “Unique Transaction Identifier”)

Este campo no podrá reportarse vacío para la información a partir del primero de diciembre de 2023. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II del formulario DC, de acuerdo a los campos llave: institución, fecha de concertación (campo 3) y número de identificación de la operación (campo 5).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de Derivados de Crédito, para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER, (DC).