



BANCO DE MÉXICO

**Formulario relativo a opciones y títulos opcionales
(Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y
sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)
Ayudas**

CONTENIDO

Ayudas generales.....	4
I. Fundamento legal del requerimiento de información	4
II. Objetivo del requerimiento	5
III. Definiciones.....	5
IV. Cobertura del formulario.....	6
V. Contenido del formulario	6
VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos de Banco de México	8
VI. Metodologías de confrontas	9
VII. Fecha y horario de entrega de la información.....	9
VIII. Estructura del formulario por sección	10
Ayudas específicas para cada campo del formulario	25
Sección I.- Opciones Celebradas en Mercados Reconocidos (Bursátiles).	25
Sección II.- Opciones Celebradas en Mercados No Reconocidos.	27
Complemento de la Sección II.- Paquetes de Opciones celebradas en Mercados No Reconocidos.	38
Sección III.- Operaciones con Títulos Opcionales “Warrants”	41
Sección IV.- Información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en Mercados No Reconocidos.	43
Sección V.- Información del ejercicio de Opciones celebradas tanto en Mercados Reconocidos como en Mercados No Reconocidos (incluyendo títulos opcionales o “Warrants”).	47
Sección VI.- Información sobre la “Convalidación” de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en Mercados Reconocidos.....	50
Secciones VII.- Información sobre la “Convalidación” de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en Mercados No Reconocidos.	52
Sección VIII.- Información sobre la “Convalidación” de operaciones con Títulos Opcionales “Warrants” vigentes a la fecha de corte.	54

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Sección IX.- Operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos.	56
Complemento de la Sección IX.- Complemento de operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos..	84
Secciones X.- Información sobre la “Convalidación” de las opciones vigentes a la fecha de corte, de operaciones que fueron previamente reportadas en la Sección IX.....	91
Secciones XI.- Información sobre las “Canastas” subyacentes en opciones celebradas en mercados no reconocidos	98
Secciones XII.- Información sobre Curvas de Sensibilidad y factores de riesgo en opciones celebradas en mercados no reconocidos	101
Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario	105
Sección I.- Opciones Celebradas en Mercados Reconocidos (Bursátiles)	105
Sección II.- Opciones Celebradas en Mercados No Reconocidos.	108
Complemento de la Sección II (paquetes de opciones celebradas en mercados no reconocidos)	123
Sección III.- Operaciones con títulos opcionales (“Warrants”)	126
Sección IV.- Vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en mercados no reconocidos	129
Sección V.- Información del ejercicio de opciones celebradas tanto en Mercados Reconocidos como en Mercados No Reconocidos (incluyendo títulos opcionales o “Warrants”)	136
Sección VI.- Convalidación de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos	141
Sección VII.- Convalidación de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos	144
Sección VIII.- Convalidación de operaciones con títulos opcionales (“warrants”) vigentes a la fecha de corte	146
Sección IX.- Opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato..	148
Complemento de la sección IX (paquetes de opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato).....	180
Sección X.- Convalidación de opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato y celebradas en Mercados No Reconocidos.	186

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Secciones XI.- Información sobre las “Canastas” subyacentes en opciones celebradas en Mercados No Reconocidos.	192
Secciones XII.- Información sobre Curvas de Sensibilidad y factores de riesgo en opciones celebradas en mercados no reconocidos	194

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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 4/2012 del Banco de México, Numeral 12

Información

“12.1 Las Entidades, 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 través de la Dirección de Información del Sistema Financiero. Al proporcionar la información mencionada, las instituciones financieras referidas deberán indicar su Código LEI, así como el de sus contrapartes que aquellas hayan recabado en cumplimiento a lo dispuesto por el numeral 4, segundo párrafo, de las presentes Reglas. Asimismo, dichas instituciones financieras deberán informar de cualquier modificación realizada a su Código LEI, así como el de sus contrapartes que sea de su conocimiento, a más tardar a los 10 Días Hábiles posteriores a aquel en que se haya hecho efectiva la modificación a su respectivo Código LEI o hayan conocido la modificación al Código LEI de la contraparte de que se trate.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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”.

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 opción y títulos opcionales (“Warrants”), medición de la exposición al riesgo de dichas operaciones, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.”.

III. Definiciones

Para efectos de este formulario se entenderá como:

- *Operaciones*, a las opciones y a las operaciones con títulos opcionales (“Warrants”).
- *Día hábil, Divisas, Fecha de liquidación, Liquidación, Mercados reconocidos, Operaciones derivadas, Subyacentes y Operaciones Estructuradas*, 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, así como a los mercados extrabursátiles (OTC: “Over the counter”).
- *Opciones simples a las opciones tipo “Call”, “Put” o “Digital” con un solo precio de ejercicio, sin posibilidad de rebate y hasta con dos posibles precios barrera*.
- *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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

de una sola transacción. Un caso particular de “paquete de derivados” son los “paquetes de opciones” (es decir, donde todos los derivados en un mismo contrato se refieren a opciones) negociados en mercados OTC, tales como los “Caps”, “Floors” y “Collars”. Otro caso particular de “paquetes de derivados” es el “swaption”, el cual consiste en una opción cuyo subyacente es un “swap”.

- *Paquetes de opciones* (negociados en mercados no reconocidos), a la contratación simultánea de distintas opciones al amparo de una sola transacción con una misma contraparte. Dos casos particulares de “paquetes de opciones” son los conocidos como “Caps” y “Floors”.
- *Operaciones Estructuradas en mercados no reconocidos*, a los instrumentos en los cuales se tiene un contrato principal, el cual contenga una parte referida a activos o pasivos que no son Operaciones Derivadas, incluyendo de forma enunciativa a las operaciones de crédito, emisiones de bonos u otros instrumentos de deuda, y otra parte representada por una o más Operaciones Derivadas
- *Parámetros principales de opciones en mercados no reconocidos*, al importe base de referencia, al periodo de cada posible ejercicio, y al tipo de subyacente, relativos a un determinado contrato de opción.

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, por Casa de Bolsa, por la Financiera o por Sociedad Financiera de Objeto Múltiple Regulada, según se trate), tanto por cuenta propia, como por cuenta de terceras personas (personas clientas); 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, 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 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 opción (incluyendo las implícitas en notas, títulos u Operaciones Estructuradas) y sobre títulos opcionales (“Warrants”), una a una. Las operaciones de opción consideradas como simples a las que se refiere la Ayuda General III y que no conformen algún tipo de “operaciones estructuradas” o de “paquete de derivados” deberán ser reportadas en la Sección II.

Al efecto, en la Sección IX deberán reportar: las operaciones de opción incrustadas en “operaciones estructuradas” u operaciones de opción en “paquetes de derivados”, a las que se refiere la Ayuda

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

General III; así como aquellas operaciones de opción que las instituciones empaqueten para su negociación; o aquellas operaciones de opción realizadas bajo un mismo contrato con el objetivo de generar alguna estructura de pagos para un perfil de riesgo; así como las operaciones que por su estructura de pagos no puedan considerarse como operaciones simples, entre éstas, aquellas que presenten cualquier exotividad que no pueda reportarse en la Sección II (por ejemplo, características de tipos de ejercicio, callable, rebates, etc.). Asimismo, cuando se trate de paquetes o estructuras, la institución deberá informar cada una de las opciones individuales comprendidas en la transacción o contrato por medio de la Sección IX. Si existiera alguna operación que por sus características no pueda desagregarse en sus componentes, o en caso de que no puedan reportar alguna exotividad o característica de alguna operación en especial, deberán ponerse en contacto con la Subgerencia de Información de Moneda Extranjera y Derivados perteneciente a la Dirección de Información del Sistema Financiero en Banco de México, para revisar el caso en particular.

Es importante recordar que en la Sección II deberán informar las opciones simples sin características exóticas en sus estructuras de pago.

En particular, el paquete de derivados conocido como “Collar” podrá reportarse en un solo registro utilizando el campo 11 (“Tipo de opción”) y el campo 12 (“Tipo de opción dos”), o podrá reportarse como dos “paquetes de opciones” (o registros) como un “Cap” y un “Floor”. Asimismo, los dos registros de dicho “Collar” deben reportarse con las claves “1” y “2”, respectivamente, en el campo 43 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) de la sección IX, además de tener la misma “Clave o Folio con el que se identifica al Conjunto de Operaciones que forman parte de una operación estructurada o paquete (campo 44)”, y los dígitos “1” y “2”, respectivamente, en el campo 45 (“Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de una operación estructurada o paquete”).

El formulario está compuesto por las secciones siguientes:

Sección I. Comprende las **opciones** celebradas en **mercados reconocidos**.

Sección II. Comprende las **opciones simples** celebradas en **mercados no reconocidos**.

Sección III. Comprende las **operaciones con títulos opcionales** (“Warrants”).

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

Sección V. Para informar el **ejercicio de opciones** que fueron previamente reportadas en las secciones I, II, III y IX.

Sección VI. Para informar la **convalidación** de las **opciones vigentes a la fecha de corte**, celebradas en **mercados reconocidos**.

Sección VII. Para informar la **convalidación** de las **opciones vigentes a la fecha de corte**, celebradas en **mercados no reconocidos**.

Sección VIII. Para informar la **convalidación** de las **operaciones vigentes a la fecha de corte, con títulos opcionales** (“Warrants”).

Sección IX. Comprende las **operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”,** celebradas en mercados no reconocidos.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Sección X. Para informar la **convalidación** de las **opciones vigentes a la fecha de corte**, de operaciones que fueron previamente reportadas en la **Sección IX**.

Sección XI. Para informar las **canastas subyacentes** en operaciones de opción celebradas en **mercados no reconocidos**.

Sección XII. Comprende las **sensibilidades y factores de riesgo** en operaciones de opción celebradas en **mercados no reconocidos**.

En principio, cada contrato de opción (incluyendo los “paquetes de opciones”, tales como los “Caps” y “Floors”, siempre y cuando cumplan con todo lo señalado para dichos paquetes en la ayuda general III) celebrado en mercados no reconocidos, deberá enviarse como un solo registro en la sección IX.

Sin embargo, tanto las operaciones reportadas en la Sección II como en la Sección IX en los que al menos uno de sus “parámetros principales” se modifique en algún momento de su vigencia, se deberá enviar adicionalmente, el calendario completo de todos los periodos de ejercicio posibles, en el complemento de la Sección II y complemento de la Sección IX respectivamente, detallando cada uno de los periodos de ejercicio, y el valor del o los parámetros que se ajusten.

Para aquellas operaciones que transiten de tasas de referencia IBOR hacia alguna de las tasas de referencia libres de riesgo, que cumplan con los principios indicados por la Organización Internacional de Comisiones de Valores (IOSCO, por sus siglas en inglés), se deberá informar el cambio a través de un nuevo registro, en la fecha en que contractualmente se haya efectuado la transición, en la Sección II o IX, según corresponda. Adicionalmente, en la misma fecha deberá reportarse un vencimiento total, “VT” en la Sección IV de la operación a la que se le haya efectuado dicha transición, usando la clave “7” en el campo 11 “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, e indicar el número de identificación del nuevo registro en el campo 14 “Número de Identificación de la Nueva Operación” del registro, como resultado de la transición hacia la nueva tasa de referencia.

VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos de 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, IV, V y IX (incluyendo, en su caso, el complemento de la Sección II) del formulario.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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, IV, V y IX del formulario.

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, IV, V y IX (incluyendo, en su caso, el complemento de la Sección II) del formulario.

VI. Metodologías de confrontas

Las metodologías de las confrontas que se realizan entre la información de este formulario y la de otras fuentes de información, se encuentran en el apartado de ayudas del sistema de acopio denominado SAIF-Web.

A continuación se muestra una imagen para mayor referencia.



Los requerimientos de información por parte de Banco de México a los Intermediarios Financieros establecen un conjunto de formularios que se hacen llegar con datos a través de Internet, usando sistemas de acopio que operan bajo la plataforma Web de servicios denominada:



VII. Fecha y horario de entrega de la información

Las Secciones I, II (incluyendo, en su caso, su complemento), la Sección III y la Sección IX (incluyendo, en su caso, su complemento) de este formulario deberán enviarse con periodicidad diaria. Todas las operaciones celebradas 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 celebradas 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). Adicionalmente, si para una fecha de concertación no se realizaron operaciones, estas secciones deberán reportarse vacías.

La Sección IV de este formulario deberá enviarse en la misma fecha del evento de vencimiento anticipado, de terminación o extinción (por ejemplo, en el caso de una opción con barrera tipo “Knock-out”, en la misma fecha en que el precio de mercado del subyacente respectivo pase o toque la barrera correspondiente), o de cesión de derechos de la operación que se trate, antes de las 17:30 Horas (utilizando la opción de “Bloque” a que se refiere la Ayuda General VI). Adicionalmente, si para una fecha no existen vencimientos anticipados, terminación o extinción o de cesión de derechos esta sección deberá reportarse vacía.

Por su parte, la Sección V debe enviarse en la misma fecha del evento de ejercicio de la operación que se trate, antes de las 17:30 Horas. En particular, tratándose de “paquetes de opciones” (es decir, un contrato con múltiples opciones, tal como los “Caps”, “Floors”, “Corridor” o “Range Accrual”), en donde existen una serie de fechas posibles de ejercicio, se deberá reportar el ejercicio de cada opción individual (o flujo), en la misma fecha del evento de ejercicio que corresponda.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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 ejercicio, o que fueron enviados por error, o que alguna característica requiere ser modificada, debe enviar los registros de alta, baja y/o de cambio que correspondan (ya sea en la Sección I, II, III, IV, V y/o IX), utilizando las opciones “Alta”, “Baja” o “Cambios”, respectivamente, a que se refiere la Ayuda General VI.

Por otro lado, la Sección XI debe enviarse previo al informe de opciones sobre canastas de subyacentes en mercados no reconocidos, con la finalidad de registrar la estructura de la canasta así como la generación de la clave de la misma.

Por su parte, las Secciones VI, VII, VIII, X y XII 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 lo anterior, el envío de los paquetes deberá realizarse en un horario de 9:00 a 21:00 horas.

VIII. 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 dígito, corresponde al número máximo de posiciones decimales.

Estructura de la Sección I: Opciones celebradas en mercados reconocidos (BURSÁTILES)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
4	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	CARACTER	20
5	MERCADO	MERCADO	ANEXO S	CARÁCTER	3
6	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
7	POSICION	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
8	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
9	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
10	NUMCONTRAT	NÚMERO DE CONTRATOS		NUMÉRICO	(6,0)
11	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(13,6)
12	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
13	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

14	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
15	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
16	OPER_DER	OPERADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO P	CARACTER	6
17	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
18	DELTA	VALOR DEL PARÁMETRO "DELTA"		NUMÉRICO	(3,2)
19	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20

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

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	CONTRAPAR	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	CARÁCTER	20
4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FE_INI_OPE	FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FE_VEN_OPE	FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO, O FECHA ÚNICA DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	DIASLIQ	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(2,0)
8	POSICION	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
9	TIP_OPC	TIPO DE OPCIÓN		CARÁCTER	1
10	OPC_LIQ	MODALIDAD DE LIQUIDACIÓN AL EJERCICIO		CARÁCTER	1
11	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
12	IMPBASE	IMPORTE BASE O DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(15,0)
13	MDAIMP	MONEDA DEL IMPORTE BASE O DE REFERENCIA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
14	LIQUIDA	FORMA DE LIQUIDACIÓN		CARÁCTER	1
15	MDALIQUIDA	MONEDA DE LIQUIDACIÓN	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
16	QUANTO	EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		CARACTER	1
17	TC_QUANT	TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		NUMÉRICO	(13,6)
18	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
19	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
20	FE_PRIM	FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA		FECHA	AAAA/MM/DD
21	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE".	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
22	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
23	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
24	SUBY	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARÁCTER	3

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

25	CVE_TIT	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
26	INT_EJE	INTERVALO O FRECUENCIA DE LOS POSIBLES EJERCICIOS		NUMÉRICO	(3,0)
27	INT_MON	INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL PRECIO DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(3,0)
28	NU_TO_EJE	NÚMERO TOTAL DE POSIBLES EJERCICIOS		NUMÉRICO	(3,0)
29	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	34
30	NUMSUBY	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(9,0)
31	MDASUBY	MONEDA DEL SUBYACENTE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
32	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(13,6)
33	MDAPRECIO	MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
34	PRE_SUP	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR		NUMÉRICO	(13,6)
35	PRE_INF	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR		NUMÉRICO	(13,6)
36	MOD_PRE	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA		CARÁCTER	1
37	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	CARÁCTER	2
38	REV_OP	REVISIÓN DE LOS "PARÁMETROS PRINCIPALES"		CARÁCTER	1
39	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
40	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
41	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
42	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
43	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
44	DELTA	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(3,2)
45	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
46	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20
47	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura del Complemento de la Sección II (paquetes de opciones celebrados en mercados no reconocidos)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	CARÁCTER	20
3	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
4	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
5	NU_PE_EJE	NÚMERO DEL PERIODO DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(3,0)
6	IMPBA_CO	IMPORTE BASE APLICABLE AL PERIODO DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(15,0)
7	FEINOP_CO	FECHA DE INICIO DEL PERIODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

8	FEVEOP_CO	FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
9	SUBY_CO	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARÁCTER	3
10	CVE_TIT_C	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
11	PRECIOEJER_C	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(13,6)
12	PRE_SUP	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR		NUMÉRICO	(13,6)
13	PRE_INF	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR		NUMÉRICO	(13,6)
14	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMÉRICO	20
15	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección III: Operaciones con títulos opcionales ("Warrants")

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
4	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	CARÁCTER	20
5	CONTRAPAR	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	CARÁCTER	6
6	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN DE LA COLOCACIÓN O ADQUISICIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE_LIQ	FECHA DE LIQUIDACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
8	POSICION	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
9	CVE_TIT	CLAVE DEL TÍTULO OPCIONAL	ANEXO AB	ALFANUMÉRICO	20
10	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
11	NUM_TIT_OP	NÚMERO DE TÍTULOS OPCIONALES COLOCADOS O ADQUIRIDOS		NUMÉRICO	(9,0)
12	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
13	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
14	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
15	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARÁCTER	6
16	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
17	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
18	DELTA	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(3,2)
19	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
20	NUM_ID_OPC	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPCIÓN DE COBERTURA		ALFANUMÉRICO	34

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

21	INSTI_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20
----	-----------	--	--	--------------	----

Estructura de la Sección IV: 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	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	SEC_OPTO	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
4	FECVEN_CA	FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FECLIQ_CA	FECHA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		FECHA	AAAA/MM/DD
6	LIQUIDA_CA	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	NUMÉRICO	(3,0)
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		CARACTER	1
11	MOT_VENA	MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS	ANEXO R	NUMÉRICO	(1,0)
12	VEN_ANT	INDICADOR DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		CARÁCTER	2
13	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN (ORIGINAL)		ALFANUMÉRICO	34
14	NUM_ID_CP	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA NUEVA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
15	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20
16	UTI_O	UTI ORIGINAL		ALFANUMÉRICO	52
17	UTI_N	UTI NUEVO		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección V: Información del ejercicio de opciones celebradas tanto en mercados reconocidos como no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
3	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	CARÁCTER	20
4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	SEC_OPTO	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

6	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
7	FE_EJE	FECHA DE EJERCICIO DE LA OPERACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
8	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(13,6)
9	IMP_EJE_OP	IMPORTE EJERCIDO EN LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
10	MDA_EJE_OP	MONEDA DEL IMPORTE EJERCIDO EN LA OPERACIÓN	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
11	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20
12	SUBY	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARÁCTER	3
13	CVE_TIT	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
14	PRECIO_SUBY	VALOR DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(18,13)
15	LIQUIDA	FORMA DE LIQUIDACIÓN		CARÁCTER	1
16	IMP_EJE_PAR	IMPORTE EJERCIDO PARCIAL		NUMÉRICO	(22,8)
17	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección VI: Información sobre la “Convalidación” de opciones 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	PRO_TER	ORIGEN DE LA POSICIÓN		CHARACTER	1
3	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	CHARACTER	20
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	POSICION	POSICIÓN POR PIZARRA		CARÁCTER	1
6	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
7	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR	ANEXO O	CHARACTER	6
8	CONTRAT_VIG	NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES (ABIERTOS) EN POSICIÓN.		NUMÉRICO	(6,0)
9	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA POSICIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
10	PAQ_OPC	LA POSICIÓN ES PARTE DE UN "PAQUETE", CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.		CHARACTER	1
11	VOL_IMPLIC	VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA		NUMÉRICO	(5,2)
12	DELTA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(3,2)
13	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
14	ID_GAR_VIG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA POSICIÓN		ALFANUMÉRICO	20
15	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Estructura de la Sección VII: Información sobre la “Convalidación” de opciones 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	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
4	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
5	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
6	VOL_IMPLIC	VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA		NUMÉRICO	(5,2)
7	DELTA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(3,2)
8	PAQ_OPC	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UN "PAQUETE", CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.		CARACTER	1
9	ID_PAQ	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN " PAQUETE "		ALFANUMÉRICO	20
10	CONSEC_PAQ	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN " PAQUETE "		NUMÉRICO	(3,0)
11	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
12	ID_GAR_VIG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20
13	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMÉRICO	20
14	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER”)		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección VIII: Información sobre la “Convalidación” de operaciones con títulos opcionales (“warrants”) vigentes a la fecha de corte

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	PRO_TER	ORIGEN DE LA POSICIÓN		CARACTER	1
3	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	CARACTER	20
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	CVE_TIT	CLAVE DEL TÍTULO OPCIONAL	ANEXO AB	ALFANUMÉRICO	20
6	NUM_TIT_PV	NÚMERO DE TÍTULOS OPCIONALES EN POSICIÓN		NUMÉRICO	(6,0)
7	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA POSICIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
8	VAL_MDO	VALOR DE MERCADO DE LOS TÍTULOS OPCIONALES EN POSICIÓN		NUMÉRICO	(15,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

9	VOL_IMPLIC	VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA		NUMÉRICO	(5,2)
10	DELTA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(3,2)
11	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(15,0)
12	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20

Estructura de la Sección IX: Operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos.

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	CONTRAPAR	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
5	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FE_INI_OPE	FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE_VEN_OPE	FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO, O FECHA ÚNICA DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
8	OTRO_DER	OTRO TIPO DE DERIVADO VINCULADO AL CONJUNTO DE OPCIONES	ANEXO AJ	NUMÉRICO	(2,0)
9	DIASLIQ	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(2,0)
10	POSICION	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
11	TIP_OPC	TIPO DE OPCIÓN		CARÁCTER	2
12	TIP_OPC2	TIPO DE OPCIÓN DOS		CARÁCTER	2
13	OPC_EJER	MODALIDAD DEL EJERCICIO		CARÁCTER	1
14	OBJETIVO	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
15	IMPBASE	IMPORTE BASE O DE REFERENCIA		NUMÉRICO	(22,8)
16	MDAIMP	MONEDA DEL IMPORTE BASE O DE REFERENCIA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
17	LIQUIDA	FORMA DE LIQUIDACIÓN		CARÁCTER	1
18	MDALIQUIDA	MONEDA DE LIQUIDACIÓN	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
19	FE_FLU	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
20	FEN_FLU	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
21	DET_FLUJO	ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS	ANEXO I	CARACTER	2
22	NU_FLUJO	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

23	INT_FLUJO	INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
24	TASA_REF	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR O ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
25	REV_TREF	INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
26	ANIO	AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (RECIBIR O ENTREGAR)		CARÁCTER	1
27	FE_REF	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR O ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3
28	FAC_TASA	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
29	SPREAD	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
30	TASA_FIJA	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
31	CAL_LIQ	CÁLCULO DE LIQUIDACIÓN	ANEXO AK	NUMÉRICO	(2,0)
32	CAL_LIQ2	CÁLCULO DE LIQUIDACIÓN DOS	ANEXO AK	NUMÉRICO	(2,0)
33	FAC_LIQ	FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(3,6)
34	DIF	DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(3,6)
35	FAC_LIQ2	FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN DOS		NUMÉRICO	(3,6)
36	DIF2	DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN DOS		NUMÉRICO	(3,6)
37	MMRIA_PAGO	MEMORIA DEL PAGO		CARÁCTER	1
38	CON_TERM	CONDICIÓN DE TERMINACIÓN ANTICIPADA O CANCELACIÓN DEL PAGO DEL PAGO	ANEXO AL	NUMÉRICO	(2,0)
39	N_CAN	NÚMERO DE OCURRENCIAS DE LA CONDICIÓN NECESARIA PARA LA TERMINACIÓN ANTICIPADA O CANCELACIÓN DEL PAGO DEL PAGO		NUMÉRICO	(2,0)
40	QUANTO	EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		CARACTER	1
41	TC_QUANT	TIPO DE CAMBIO FORWARD "QUANTO"		NUMÉRICO	(13,6)
42	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(22,8)
43	MDAPRIMA	MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA PRIMA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
44	FE_PRIM	FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA		FECHA	AAAA/MM/DD
45	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
46	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	35
47	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
48	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	CARÁCTER	2
49	SUBY	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARÁCTER	3

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

50	CVE_TIT	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
51	INT_EJE	INTERVALO O FRECUENCIA DE LOS POSIBLES EJERCICIOS		NUMÉRICO	(3,0)
52	INT_MON	INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL PRECIO DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(3,0)
53	N_MONSUBY	NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(3,0)
54	NU_TO_EJE	NÚMERO TOTAL DE POSIBLES EJERCICIOS		NUMÉRICO	(3,0)
55	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE O VINCULADA AL CONJUNTO DE OPCIONES		ALFANUMÉRICO	34
56	SECCION_SWP	SECCIÓN DEL FORMULARIO SWAPS A LA QUE PERTENECE LA OPERACIÓN SWAP		NUMÉRICO	1
57	NUMSUBY	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(9,0)
58	MDASUBY	MONEDA DEL SUBYACENTE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
59	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(18,13)
60	TIP_PRECIO	FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO	ANEXO AM	NUMÉRICO	(2,0)
61	MDAPRECIO	MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
62	CAL_EJERCICIO	CÁLCULO PARA DETERMINAR EL NIVEL DEL SUBYACENTE PARA EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN	ANEXO AN	NUMÉRICO	(2,0)
63	N_EJERCICIO	NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(3,0)
64	PRECIOEJER2	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS		NUMÉRICO	(18,13)
65	TIP_PRECIO2	FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO DOS	ANEXO AM	NUMÉRICO	(2,0)
66	MDAPRECIO2	MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
67	CAL_EJERCICIO2	CÁLCULO PARA ESTABLECER EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN DOS	ANEXO AN	NUMÉRICO	(2,0)
68	N_EJERCICIO2	NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DE EJERCICIO DOS		NUMÉRICO	(3,0)
69	PRECIO_INICIAL	PRECIO INICIAL DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(18,13)
70	PRE_SUP	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
71	PRE_INF	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
72	MOD_PRE	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA	ANEXO AO	CARÁCTER	6
73	INT_MON_BA	INTERVALO O FRECUENCIA DEL MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA		NUMÉRICO	(3,0)
74	FE_INI_VEN	FECHA DE INICIO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA		FECHA	AAAA/MM/DD
75	FE_VEN_VEN	FECHA DE TÉRMINO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA		FECHA	AAAA/MM/DD
76	PRE_SUP2	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR DOS		NUMÉRICO	(18,13)
77	PRE_INF2	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR DOS		NUMÉRICO	(18,13)
78	MOD_PRE2	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA DOS	ANEXO AO	CARÁCTER	6

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

79	INT_MON_BA2	INTERVALO O FRECUENCIA DEL MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA DOS		NUMÉRICO	(3,0)
80	FE_INI_VEN2	FECHA DE INICIO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS		FECHA	AAAA/MM/DD
81	FE_VEN_VEN2	FECHA DE TÉRMINO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS		FECHA	AAAA/MM/DD
82	REBATE	REBATE		NUMÉRICO	(3,6)
83	CALLABLE	CALLABLE		CARÁCTER	2
84	REV_OP	REVISIÓN DE LOS "PARÁMETROS PRINCIPALES"		CARÁCTER	1
85	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
86	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
87	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
88	REP_DEV	REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
89	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
90	UPI	IDENTIFICADOR ÚNICO DEL PRODUCTO		ALFANUMÉRICO	12
91	DELTA	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(22,8)
92	VOL	VOLATILIDAD IMPLÍCITA		NUMÉRICO	(3,6)
93	ID_CONT_ANF	IDENTIFICACIÓN DEL CONTRATO ANFITRIÓN		ALFANUMÉRICO	34
94	NUM_ID_INST	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN UTILIZADO POR LA INSTITUCIÓN (INTERNO)		ALFANUMÉRICO	52
95	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
96	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura del Complemento de la Sección IX: (Complemento de las operaciones de opción con estructuras exóticas, así como de las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos.)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN (UTI)		ALFANUMÉRICO	52
4	NU_PE_EJE	NÚMERO DEL PERIODO DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(3,0)
5	IMPBA_CO	IMPORTE BASE APLICABLE AL PERIODO DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(22,8)
6	FEINOP_CO	FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FEVEOP_CO	FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO		FECHA	AAAA/MM/DD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

8	DIASLIQ	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(2,0)
9	FAC_LIQ	FACTOR APLICADO A LA LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(3,6)
10	DIF	DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(3,6)
11	MMRIA_PAGO	MEMORIA DEL PAGO		CARÁCTER	1
12	SUBY_CO	TIPO DE SUBYACENTE	ANEXO F	CARÁCTER	3
13	CVE_TIT_C	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
14	PRECIOEJER_C	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(18,13)
15	PRE_SUP	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
16	PRE_INF	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
17	MOD_PRE	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA	ANEXO AO	CARÁCTER	6
18	FE_INI_VEN	FECHA DE INICIO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA		FECHA	AAAA/MM/DD
19	FE_VEN_VEN	FECHA DE TÉRMINO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA		FECHA	AAAA/MM/DD
20	PRECIOEJER_C2	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS		NUMÉRICO	(18,13)
21	PRE_SUP2	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR DOS		NUMÉRICO	(18,13)
22	PRE_INF2	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR DOS		NUMÉRICO	(18,13)
23	MOD_PRE2	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA DOS	ANEXO AO	CARÁCTER	6
24	FE_INI_VEN2	FECHA DE INICIO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS		FECHA	AAAA/MM/DD
25	FE_VEN_VEN2	FECHA DE TÉRMINO DEL PERIODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS		FECHA	AAAA/MM/DD
26	REBATE_C	REBATE		NUMÉRICO	(3,6)
27	CALLABLE	CALLABLE		CARÁCTER	2
28	FE_FLU	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
29	FEN_FLU	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
30	FAC_TASA	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
31	SPREAD	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
32	TASA_FIJA	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR O ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,6)
33	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN		ALFANUMERICO	20
34	PRIMA	IMPORTE DE LA PRIMA		NUMÉRICO	(22,8)
35	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Estructura de la Sección X: Información sobre la “Convalidación” de las opciones vigentes a la fecha de corte, de operaciones que fueron previamente reportadas en la Sección IX.

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
4	LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO “LEGAL ENTITY IDENTIFIER”) DE LA INSTITUCIÓN	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
5	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	52
6	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
7	NATURALEZA	POSICIÓN DE LA OPERACIÓN		CARÁCTER	1
8	VOL_IMPLIC	VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA		NUMÉRICO	(3,6)
9	DELTA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO DELTA		NUMÉRICO	(22,8)
10	MDADELTA	MONEDA DEL PARÁMETRO DELTA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
11	GAMMA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO GAMMA		NUMÉRICO	(22,8)
12	VEGA_OPC	VALOR DEL PARÁMETRO VEGA		NUMÉRICO	(22,8)
13	RHO	VALOR DEL PARÁMETRO RHO		NUMÉRICO	(22,8)
14	TASA_RHO	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA RHO DE LA OPERACIÓN	ANEXO AF o ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	20
15	PHI	VALOR DEL PARÁMETRO RHO DOS		NUMÉRICO	(22,8)
16	TASA_PHI	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR UNA SEGUNDA SENSIBILIDAD	ANEXO AF o ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	20
17	RHO_COL	VALOR DEL PARÁMETRO RHO TRES		NUMÉRICO	(22,8)
18	TASA_RHO_COL	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR UNA TERCERA SENSIBILIDAD	ANEXO AF o ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	20
19	PRECIO_CORTE	PRECIO DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(18,13)
20	SEN_COMP	COMPLEMENTO DE CURVAS DE SENSIBILIDAD		CARACTER	1
21	CURVA_REF	CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD	ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	34
22	CURVA_REF2	CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD DOS	ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	34
23	CURVA_REF3	CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD TRES	ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	34
24	PAQ_OPC	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UN "PAQUETE", CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B.		CARACTER	1
25	ID_PAQ	CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN "PAQUETE"		ALFANUMÉRICO	35
26	CONSEC_PAQ	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
27	PRI_ACT	IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)		NUMÉRICO	(22,8)
28	ID_GAR_VIG	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

29	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52
----	-----	--	--	--------------	----

Estructura de la Sección XI: Información sobre las “Canastas” subyacentes en opciones celebradas en mercados no reconocidos.

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	CLAVE_CAN	CLAVE DE LA CANASTA	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
2	NST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
3	CLAVE_AF	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
4	CON_CAN	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR AL SUBYACENTE QUE FORMA PARTE DE LA CANASTA		NUMÉRICO	(3,0)
5	TIPO_MONITOR	TIPO DE MONITOREO		CARÁCTER	2
6	PONDERADOR	PONDERADOR		NUMÉRICO	(3,6)
7	PRECIOEJER	PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO		NUMÉRICO	(18,13)
8	TIP_PRECIO	FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO	ANEXO AM	NUMÉRICO	(2,0)
9	MDAPRECIO	MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
10	PRECIO_INICIAL	PRECIO INICIAL DEL SUBYACENTE		NUMÉRICO	(18,13)
11	CAL_EJERCICIO	CÁLCULO APLICABLE AL PRECIO DEL SUBYACENTE PARA DETERMINAR EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN	ANEXO AN	NUMÉRICO	(2,0)
12	CAL_LIQ	CÁLCULO DE LIQUIDACIÓN	ANEXO AK	NUMÉRICO	(2,0)
13	FAC_LIQ	FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(3,6)
14	PRE_SUP	PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
15	PRE_INF	PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR		NUMÉRICO	(18,13)
16	MOD_PRE	MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA	ANEXO AO	CARÁCTER	6
17	INT_MON_BA	INTERVALO O FRECUENCIA DEL MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA		NUMÉRICO	(3,0)

Estructura de la Sección XII: Información sobre Curvas de sensibilidad y factores de riesgo en opciones celebradas en mercados no reconocidos.

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARACTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
4	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN ASOCIADA A LA OPCIÓN		ALFANUMÉRICO	34

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5	CON_SEN	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR REGISTROS QUE FORMAN PARTE DEL FACTOR DE RIESGO		NUMÉRICO	(3,0)
6	FAC_RIESGO	NOMBRE DEL FACTOR DE RIESGO	ANEXO AR	CARACTER	3
7	CLAVE_AF	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO	ANEXO AF o ANEXO AT	ALFANUMÉRICO	20
8	FECHA	FECHA DEL NODO DE LA CURVA		FECHA	AAAA/MM/DD
9	PLAZO	PLAZO		NUMÉRICO	(22,0)
10	TEMP_PLAZO	TEMPORALIDAD DEL PLAZO	ANEXO AS	CARACTER	2
11	VAL_GRIEGA	VALOR DE LA GRIEGA O SENSIBILIDAD		NUMÉRICO	(22,8)
12	MDAGRIEGA	MONEDA DE LA GRIEGA O SENSIBILIDAD	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
13	VAL_VAR	VALOR ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO		NUMÉRICO	(22,8)
14	MDA_VAR1	MONEDA DEL VALOR DE LA VARIABLE UTILIZADA PARA EL FACTOR DE RIESGO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
15	VAL_VAR2	VALOR DOS ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO		NUMÉRICO	(22,8)
16	MDA_VAR2	MONEDA DEL VALOR DE LA VARIABLE DOS UTILIZADA PARA EL FACTOR DE RIESGO	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
17	PRECIO_SUBY	PRECIO DEL SUBYACENTE UTILIZADO PARA EL FACTOR DE RIESGO		NUMÉRICO	(22,8)
18	CONSECUTIVO	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR REGISTROS QUE FORMAN PARTE DEL MISMO ENVÍO		NUMÉRICO	10

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Ayudas específicas para cada campo del formulario

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

Sección I.- Opciones Celebradas en Mercados Reconocidos (Bursátiles).

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. 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.

3. ORIGEN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

P Cuando se trate de una operación celebrada por cuenta propia.

T Cuando se trate de una operación celebrada por la institución (distinta a la figura de operador y/o socio liquidador) por cuenta de una tercera persona (persona cliente).

4. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 3), se deberá anotar la clave de la persona cliente (o tercera persona) a nombre del cual la institución celebró la operación o el Código LEI, siempre y cuando dicha persona cumpla con lo señalado en el numeral cuatro inciso b) de la Circular 4/2012, lo anterior conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Si la operación fue por cuenta propia deberá registrarse el Código LEI de la institución (el mismo registrado en el campo 19 “Código LEI de la Institución”).

5. MERCADO

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

6. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

7. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

E Cuando la Institución emita la opción.

A Cuando la Institución adquiera la opción.

8. CLAVE DE PIZARRA.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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

9. 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.

10. NÚMERO DE CONTRATOS

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

11. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Según sea el caso, se deberá anotar (con enteros y seis decimales) el precio unitario, o la tasa de ejercicio, pactado para el subyacente que se trate, por contrato.

En el caso de un precio, éste se deberá anotar en unidades de la moneda en que está expresado, conforme al contrato de que se trate. Tratándose de tasas de interés, éstas deberán anotarse en porcentaje y en términos anuales.

12. IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el importe total de la prima relativa a la opción, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato.

13. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe de la prima (campo 12), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

14. 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 6). En caso de que la operación tenga asignado un número único se deberá registrar en este campo.

15. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

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

16. 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 opción, 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).

17. CÁMARA DE COMPENSACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

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 5, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

18. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor pactado del parámetro “delta” de la opción (en términos de probabilidad), en la fecha de concertación correspondiente (campo 6).

19. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección II.- Opciones Celebradas en Mercados No Reconocidos.

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. 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.

3. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave vigente de la contraparte 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 el evento que una determinada contraparte, o su correspondiente Código LEI, no estuviera en dicho catálogo, ésta deberá informarse previamente en el formulario denominado “Contrapartes”, en el cual se asignará una clave única que deberá utilizarse en este campo.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

5. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE EJERCICIO

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Americana” o “Bermuda” (claves “A” y “B” en el campo 10), se deberá anotar, la fecha de inicio del período de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Europea” (clave “E” en el campo 10), esta fecha deberá ser la misma que la de concertación (campo 4).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), esta fecha corresponde al inicio del primer periodo de ejercicio (por ejemplo, del “Caplet” o “Floorlet”) de la operación de que se trate.

6. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO, O FECHA ÚNICA DE EJERCICIO

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Americana” o “Bermuda” (claves “A” y “B” en el campo 10), se deberá anotar, la fecha de término del período de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Europea” (clave “E” en el campo 10), se deberá anotar, la fecha única de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), esta fecha corresponde al término del último periodo de ejercicio posible (por ejemplo, del “Caplet” o “Floorlet”) de la operación de que se trate.

7. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible, se deberá anotar, el número de días hábiles, posteriores a la fecha de ejercicio único, para liquidar la operación de que se trate.

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), se debe reportar el número de días hábiles posteriores a la fecha de término del último periodo de ejercicio posible (por ejemplo, del “Caplet” o “Floorlet”) de la operación de que se trate.

En caso que la liquidación se realice en la misma fecha en que la operación es ejercida, se deberá reportar “0” (cero) en este campo.

8. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

E Cuando la Institución emita la opción.

A Cuando la Institución adquiera la opción.

9. TIPO DE OPCIÓN

Se deberá anotar:

C En el caso de opciones de compra (“Call”).

V En el caso de opciones de venta (“Put”).

O En el caso de opciones “binarias” o “digitales” (“todo o nada”), en las que eventualmente se paga o cobra un importe monetario fijo.

10. MODALIDAD DE LIQUIDACIÓN AL EJERCICIO

Se deberá anotar:

Uso Público

Información de acceso público.

- A** En el caso de opciones con ejercicio tipo “Americano” (Cualquier día hábil dentro de la fecha de inicio y de término del periodo de ejercicio).
- E** En el caso de opciones con ejercicio tipo “Europea” (Exclusivamente en la fecha de término del periodo de ejercicio).
- B** En el caso de opciones con ejercicio tipo “Bermuda” (Cualquier día hábil de un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas, dentro de la fecha de inicio y de término del periodo de ejercicio).

11. 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.

12. IMPORTE BASE O DE REFERENCIA

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una divisa (claves de la “32” a la “986” en el campo 24), tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24) o tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), se deberá anotar el importe base (o referencia) correspondiente, en miles de unidades (redondeado sin decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato.

En el caso de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea distinto a una divisa, tipo de cambio o tasa de interés, este campo debe ser igual al producto del campo 30 (número de unidades del subyacente) por el campo 32 (Precio unitario) dividido entre mil.

En el caso de opciones “binarias” o “digitales” (“todo o nada”), se deberá anotar el importe fijo correspondiente, en miles de unidades (redondeado sin decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato.

13. MONEDA DEL IMPORTE BASE O DE REFERENCIA

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una divisa (claves de la “32” a la “986” en el campo 24), tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24) o tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe base respectivo (campo 12), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En el caso de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea distinto a una divisa, tipo de cambio o tasa de interés, la clave de este campo deberá ser la misma que la correspondiente a la moneda del precio unitario (campo 33).

En el caso de opciones “binarias” o “digitales” (“todo o nada”), se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe fijo respectivo (campo 12).

14. FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación (distinta a las opciones “binarias” o “digitales”) tenga que ser liquidada mediante entrega del subyacente.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

- D** Cuando la operación tenga que ser liquidada “por diferencias” (o en efectivo, en el caso de opciones “binarias” o “digitales”).

15. MONEDA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar la clave de la moneda con que se liquidará el subyacente o, en su caso, “la diferencia”, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

16. EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Se deberá anotar:

S Cuando la operación contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”). Esto sucede (en el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales”) cuando la moneda de liquidación es diferente de la moneda de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio). En el caso de operaciones “binarias” o “digitales”, esto puede suceder cuando la moneda del importe fijo es diferente de la moneda de liquidación.

N Cuando la operación (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) no contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”); y por tanto, la moneda de liquidación es igual a la moneda de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio); o a la moneda del importe fijo correspondiente.

17. TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Tratándose de operaciones (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) que contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “S” en el campo 16, se deberá anotar dicho tipo de cambio (expresado en unidades de la moneda de liquidación por unidad de la moneda del subyacente, con enteros y hasta seis decimales).

Tratándose de operaciones (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) que no contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “N” en el campo 16, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

18. IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)

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

19. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe de la prima (campo 18), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

20. FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA

Se deberá anotar la fecha de pago o cobro de la prima de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

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

En caso que la operación individual haya sido contratada como parte de una misma “operación estructurada” o “paquete”, conforme a lo señalado en la Ayuda General III, se

Uso Público

Información de acceso público.

deberá anotar la clave que corresponda conforme al “Catálogo de Operaciones Estructuradas o Paquetes de Derivados” a que se refiere el Anexo J.

Sí la operación no fue contratada de acuerdo a lo anterior, se deberá anotar la clave “90” (No aplica).

22. 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” (clave distinta a “90” en el campo 21), 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.

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (“90” en el campo 21) este campo debe reportarse con “NA” (No aplica).

23. 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” (clave distinta a “90” en el campo 21), 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 asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma clave de institución (campo 1), fecha de concertación (campo 4) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 22).

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (“90” en el campo 21) este campo deberá reportarse con “0” (cero).

24. TIPO DE SUBYACENTE.

Se deberá anotar la clave del subyacente objeto de la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (es decir, cualquier opción, incluyendo las “binarias” o “digitales”, sobre divisas que se liquide por diferencias), en este campo se debe registrar la clave “TIC”, mientras que en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda al tipo de cambio de la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo “14-Forma de Liquidación” se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” sobre divisas (es decir, opciones sobre divisas que se liquiden por entrega física), en este campo se debe reportar la

Uso Público

Información de acceso público.

clave (conforme al Anexo F) de la divisa a recibir, en el caso de compras, o la divisa a entregar, en el caso de ventas. Por su parte, en el campo “15-Moneda de liquidación” se deberá registrar la clave de la divisa con la que se liquidará la operación de que se trate. Adicionalmente, en dicho campo 15 se debe reportar la clave “S” (relativa a liquidación por entrega del subyacente).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una tasa de interés, en este campo se debe registrar la clave “TIM”, cuando la tasa de interés sea cotizada en México (por ejemplo, la TIIE), o la clave “TIX”, cuando la tasa de interés no sea cotizada en México (por ejemplo, la LIBOR). Asimismo, en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda a la tasa de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “14-Forma de Liquidación” se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre una acción o título representativo de capital, en este campo se debe registrar la clave “ACM”, cuando dicha acción sea de una empresa residente en México, o la clave “ACE”, cuando dicha acción sea de una empresa residente en el extranjero. Asimismo, en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda a la acción o título representativo de capital de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un índice accionario, en este campo se debe registrar la clave “IAM”, cuando dicho índice sea cotizado en la Bolsa Mexicana de Valores, o la clave “IAX”, si el índice es cotizado en alguna bolsa de valores del extranjero. Asimismo, en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda al índice de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo 15 se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre un título de deuda, en este campo se debe registrar la clave “TDM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TDE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en el extranjero. Asimismo, en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda al título de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un título referenciado (incluyendo los certificados bursátiles fiduciarios o “Exchange Traded Funds” o “ETF’s”), en este campo se debe registrar la clave “TRM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TRE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en el extranjero. Asimismo, en el campo “25-Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave correspondiente al título referenciado de que se trate, conforme al Anexo AF.

25. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 24), c) un título de deuda

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

(claves “TDM” o “TDE” en el campo 24), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 24), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 24), o f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 24), se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente 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 subyacente sea distinto de los mencionados títulos, índices accionarios, tasas de interés, o tipos de cambio, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

26. INTERVALO O FRECUENCIA DE LOS POSIBLES EJERCICIOS

En el caso de operaciones cuya modalidad de ejercicio único sea tipo “Bermuda” (clave B en el campo 10), se deberá anotar la frecuencia con la que se puede ejercer la opción, expresada en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia del posible ejercicio es semanal, entonces en este campo deberá registrarse 7 (siete).

Asimismo, en el caso de “paquetes de opciones”, tales como los “Caps” o “Floors” (cuyo subyacente es una tasa de interés), en donde existen una serie de fechas de ejercicio y liquidación, se deberá anotar el tamaño promedio del intervalo de liquidación de los posibles ejercicios (por ejemplo, de los “caplets” o “floorlets”) en el contrato de que se trate, expresado en número de días naturales. Por ejemplo, si el tamaño promedio del intervalo de liquidación de los posibles ejercicios es de 28 días, entonces en este campo deberá registrarse ese número. Este campo aplica de igual forma a los “paquetes de opciones” conocidos como “Corridor” o “Range Accrual”, en los cuales existan dos o más fechas de posibles ejercicios y liquidación.

En el caso de operaciones (distintas a las “bermudas”) o de “paquetes de opciones” con un solo evento de ejercicio se debe anotar “0” (cero).

27. INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL PRECIO DEL SUBYACENTE

En el caso de operaciones distintas a “paquetes de opciones”, por ejemplo, las “binarias”, “digitales”, de “barrera” o “toque”, en donde el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” para determinar si se paga o no, o se activa o desactiva; se deberá anotar la frecuencia con la que se monitorea el precio del subyacente respectivo, expresado en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia de monitoreo es diaria o semanal, entonces en este campo deberá registrarse 1 (uno) o 7 (siete).

Por su parte, en el caso de “paquetes de opciones”, tales como los “Caps”, “Floors” o “Range Accrual”, en donde existen una serie de fechas de posibles ejercicios, se deberá anotar el tamaño promedio del intervalo con el que se monitorea el valor de mercado del subyacente, para determinar de cada uno de los posibles ejercicios. Si en cada fecha de monitoreo y posible ejercicio se liquida el importe correspondiente, entonces el valor de este campo debe ser igual al campo “26-Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios”.

En el caso de operaciones con ejercicio único y modalidad de liquidación “europea”, o distintos a las anteriores, se debe anotar “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

28. NÚMERO TOTAL DE POSIBLES EJERCICIOS

En el caso de “paquetes de opciones” (es decir, un contrato con múltiples opciones, tal como los “Caps”, “Floors”, “Corridor” o “Range Accrual”), en donde existen una serie de fechas de ejercicio y liquidación, se deberá anotar el número total de fechas posibles de liquidación en el contrato de que se trate (en unidades sin decimales). Este campo debe ser igual al resultado de dividir el plazo total del “paquete de opción” de que se trate, entre el intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios (campo 26). Por ejemplo, si el plazo total de un “Cap” o “Floor” es igual a 720 días y el intervalo de posibles fechas de liquidación es igual a 28 días (campo 26), entonces este campo debe ser igual a 25. En el caso de operaciones con un solo evento de ejercicio, se debe anotar “1” (uno).

29. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una operación derivada (es decir, de un “paquete de derivados”), en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en los formularios “OFF” o “SWAPS”, según corresponda.

Tratándose de operaciones (incluyendo las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente no sea una operación derivada, este campo debe reportarse “vacío”.

30. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE

Tratándose de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, se deberá anotar el número de unidades del subyacente de que se trate, considerando la unidad de cotización internacional que corresponda. Por ejemplo, onzas para oro y plata, “bushels” para maíz, trigo, avena y soya, unidades de índice para índices accionarios, etc.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

31. MONEDA DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar la clave de la moneda en que este denominado, o se cotice internacionalmente el subyacente indicado en el campo 25 (por ejemplo, dólares de los EE.UU.A., para oro y plata), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En operaciones cuyo subyacente sea una divisa (claves de la “32” a la “986” en el campo 24), la clave de este campo deberá ser la misma que el campo 24.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 24), la clave de este campo debe corresponder a la moneda que aparezca en los tres primeros caracteres de la clave correspondiente del campo 25 (Por ejemplo, si el campo 25 tiene la clave “GBPEUR”, entonces en este campo se debe anotar la clave “826”, relativa a Libras Esterlinas).

32. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en su fecha de concertación, en este campo se deberá anotar el precio por unidad

Uso Público

Información de acceso público.

de subyacente (en su caso, conforme a la unidad de cotización internacional que corresponda; por ejemplo, onzas para oro y plata) 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.

En el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación (por ejemplo, para las opciones tipo “lookback maxmin” o “lookback average”), se debe registrar “0” (cero).

Asimismo, tratándose de operaciones tipo “binaria” o “digital”, se debe registrar “0” (cero).

33. MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio; o en su caso, el precio de la barrera superior o inferior, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

34. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un precio o tasa superior, a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o “paga” o no, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y hasta seis decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 33)”. Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y hasta seis decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa superior, se debe registrar “0” (cero).

35. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un precio o tasa inferior, debajo de la cual la operación se “activa”, “desactiva” o “paga”, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y hasta seis decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 33)”. Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y hasta seis decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa inferior, se debe registrar “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Adicionalmente, en caso que el campo “34-Precio de la Barrera Superior” y este campo sean mayores a cero, entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al valor reportado en dicho campo 34.

36. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA

Se deberá anotar:

- I** En el caso de opciones que se activen (o paguen el importe fijo) si el precio de mercado del subyacente toca o pasa el (los) precio(s) barrera.
- O** En el caso de opciones que se desactiven o extingan (o no paguen el importe fijo) si el precio de mercado del subyacente toca o pasa el (los) precio(s) barrera.
- D** En el caso de opciones con dos precios barrera (superior e inferior), que se activen (o paguen el importe fijo, en el caso de opciones “binarias” o “digitales”) si el precio de mercado del subyacente toca o pasa uno de los dos precios barrera; y se desactiven o extingan (o no paguen el importe fijo, en el caso de opciones “binarias” o “digitales”) si el precio de mercado del subyacente toca o pasa el otro precio barrera.
- N** En el caso de opciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa barrera.

37. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Se deberá anotar la “clave” del tipo del producto derivado (Taxonomía ISDA) que corresponda a la operación (claves de la “13” a la “28” y la “49”), conforme al “Catálogo de Tipo de Producto Derivado” a que se refiere el “Anexo C”.

En particular, las opciones “implícitas” en notas, títulos, créditos, préstamos u otras “operaciones estructuradas” se deben identificar con la clave que corresponda a la operación o contrato anfitrión de que se trate (claves “50”, “51” o “52”), conforme a dicho “Anexo C”.

38. REVISIÓN DE LOS “PARAMETROS PRINCIPALES”

En el caso de paquetes de opciones (es decir, operaciones con múltiples ejercicios, tales como los “Caps” o “Floors”), se deberá anotar:

- S** Si durante la vigencia del contrato, al menos uno de los “parámetros principales” es sujeto a revisión (en este caso, debe enviarse el calendario completo de los posibles ejercicios en el Complemento de la Sección II).
- N** Si durante la vigencia del contrato ninguno de los “parámetros principales” es sujeto a revisión (Aplica también para operaciones con un solo ejercicio).

39. 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).

Uso Público

Información de acceso público.

40. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

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 41, 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).

41. CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS

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

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

42. 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 3. 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”.

43. 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.

44. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor pactado del parámetro “delta” de la opción (en términos de probabilidad y hasta dos decimales), en la fecha de concertación correspondiente (campo 4).

45. 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 asignársele a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4).

Uso Público

Información de acceso público.

46. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

47. 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.

Complemento de la Sección II.- Paquetes de Opciones celebradas en Mercados No Reconocidos.

Este complemento debe enviarse para cada “paquete de opciones” en los que al menos uno de sus “parámetros principales” se modifique en algún momento de su vigencia. De ser el caso, deberá enviarse el detalle de todos y cada uno de los posibles periodos de ejercicio que comprendan dicho paquete.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar la misma clave de institución que la reportada en el campo “1” de la Sección II para la operación correspondiente.

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave de la contraparte de la operación (la misma que la reportada en el campo “3” de la Sección II), conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B.

3. FECHA DE CONCERTACIÓN

Se deberá anotar la misma fecha de concertación que la reportada en el campo “4” de la Sección II para la operación correspondiente.

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el mismo número de identificación que el reportado en el campo “45” de la Sección II para la operación correspondiente.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5. NÚMERO DEL PERIODO DE EJERCICIO

Tratándose de “paquetes de opciones” cuyo contrato establezca que durante su vigencia, al menos uno de sus “parámetros principales” estará sujeto a revisión; en este campo se deberá anotar el número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identifica cada uno de los posibles periodos de ejercicio de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros (periodos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 3) y número de identificación (campo 4).

6. IMPORTE BASE APLICABLE AL PERIODO DE EJERCICIO

Tratándose de “paquetes de opciones” cuyo contrato establezca que durante su vigencia, el “importe base” aplicable a los posibles periodos de ejercicio estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en miles de unidades, sin decimales, de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el periodo de que se trate, este campo debe reportarse con “0” (cero).

7. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO (INDIVIDUAL) DE EJERCICIO

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada período de ejercicio de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO (INDIVIDUAL) DE EJERCICIO

Se deberá anotar la fecha de término de cada período de ejercicio de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

9. TIPO DE SUBYACENTE

Tratándose de “paquetes de opciones” cuyo contrato establezca que durante su vigencia, el tipo de subyacente estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el subyacente (conforme al Anexo F) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes. En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, este campo deberá reportarse vacío.

10. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Tratándose de “paquetes de opciones” cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio, b) una tasa de interés, c) un título de deuda (bono, certificado bursátil, certificado de depósito, etc.), d) un título representativo de capital (acción, certificado de participación ordinaria, ADR, GDR, etc.), e) un índice accionario, o f) un título referenciado a acciones (TRAC, ETF, etc.); y que además el contrato respectivo establezca que durante su vigencia, la clave del subyacente estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la “clave” (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes.

En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, en este campo se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

11. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Tratándose de “paquetes de opciones” (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y hasta seis decimales, de la moneda en que dicho precio está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión entonces debe reportarse con “0” (cero).

12. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR

Tratándose de opciones tipo “binaria”, “digital”, “barrera” o de “toque”, cuyo contrato establezca que el precio o tasa superior (a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa superior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y hasta seis decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

13. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR

Tratándose de opciones tipo “binaria”, “digital”, “barrera” o de “toque”, cuyo contrato establezca que el precio o tasa inferior (por debajo del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa inferior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y hasta seis decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

14. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

15. 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 OPTO.

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.- Operaciones con Títulos Opcionales “Warrants”.

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. 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.

3. ORIGEN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate de una operación celebrada por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una operación celebrada por cuenta de una tercera persona (persona clienta).

4. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso que la operación sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 3), se deberá anotar la clave de la persona clienta (o tercera persona), o el Código LEI, a nombre del cual la institución celebró la operación, conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Si la operación fue por cuenta propia debe registrarse el Código LEI de la institución (el mismo registrado en el campo 21 Código LEI de la Institución).

5. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave de la contraparte de la operación, conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. En el evento que una determinada contraparte no estuviera en dicho catálogo, ésta deberá informarse previamente en el formulario denominado “Contrapartes”, en el cual se asignará una clave única que deberá utilizarse en este campo.

6. FECHA DE CONCERTACIÓN DE LA COLOCACIÓN O ADQUISICIÓN

Se deberá anotar la fecha de concertación de la colocación o adquisición de los títulos opcionales (a que se refiere el campo 9), con formato AAAA/MM/DD.

7. FECHA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar la fecha de liquidación de la colocación o adquisición de los títulos opcionales a que se refiere el campo 9, con formato AAAA/MM/DD.

8. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- E** Cuando la Institución emita los títulos opcionales.
- A** Cuando la Institución adquiera los títulos opcionales.

9. CLAVE DEL TÍTULO OPCIONAL

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Se deberá anotar la “clave” que corresponda al título opcional (“Warrant”) de que se trate, conforme al “Catálogo de Títulos Opcionales” a que se refiere el Anexo AB.

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. NÚMERO DE TÍTULOS OPCIONALES COLOCADOS O ADQUIRIDOS

Se deberá anotar el número de títulos opcionales negociados en la operación, emitidos o adquiridos, según sea el caso (en unidades).

12. IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el importe total de la prima relativa a la operación, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato de que se trate.

13. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA

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.

14. 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).

15. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

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 16, 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).

16. CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS

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

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

Uso Público

Información de acceso público.

17. 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.

18. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor pactado del parámetro “delta” (en términos de probabilidad, y en unidades y hasta dos decimales) de los títulos opcionales, en la fecha de concertación correspondiente (campo 6).

19. 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 asignársele a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 4). En caso de que la operación tenga asignado un número único deberá registrarse en este campo.

20. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPCIÓN DE COBERTURA

En caso que la institución haya celebrado una o varias operaciones para cubrir los riesgos derivados de la adquisición o emisión del título opcional (“Warrant”) de que se trate, en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la opción que se haya informado en la Sección II de este formulario.

Tratándose de títulos opcionales para los que no se concertaron operaciones de cobertura, este campo deberá reportarse “vacío”.

21. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección IV.- Información de vencimientos anticipados o cesiones de derechos de operaciones celebradas en Mercados No Reconocidos.

Esta sección debe enviarse en la misma fecha de vencimiento anticipado, de cesión de derechos o de terminación (extinción), según corresponda, de la opción o título opcional (“Warrant”) 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.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

3. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave de la sección (“2”, “3” o “9”, según se trate de opciones, títulos opcionales u operaciones estructuradas, respectivamente) que corresponda a la operación original que haya sido vencida o cedida.

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”.

6. FORMA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación se haya liquidado (anticipadamente) mediante entrega del subyacente.
- 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).

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).

Uso Público

Información de acceso público.

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.

En el caso de operaciones de la Secciones I y III, en este campo se debe reportar el número de contratos (en unidades) vencidos en la fecha a la que se refiere el campo “4- Fecha de Vencimiento Anticipado”.

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

Se deberá anotar:

- 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 DE 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, en el caso de una operación “binaria” o “digital” en la que el precio de mercado del subyacente respectivo tocó o pasó el precio barrera para terminación o extinción de la operación).
- 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 o III del formulario OPTO, considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado total de que se trate.

Uso Público

Información de acceso público.

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 las Secciones II o III del formulario OPTO.

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 Secciones II o III del formulario OPTO, según corresponda, 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. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

16. 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 o IX del formulario de OPTO. Adicionalmente, si la operación corresponde a la Sección III, este campo deberá reportarse “vacío”.

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

17. 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. Adicionalmente, si la operación corresponde a la Sección III, este campo deberá reportarse “vacío”.

Uso Público

Información de acceso público.

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.

Asimismo, 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.

Sección V.- Información del ejercicio de Opciones celebradas tanto en Mercados Reconocidos como en Mercados No Reconocidos (incluyendo títulos opcionales o “Warrants”).

Esta sección debe reportarse en la misma fecha de ejercicio de la opción (tanto bursátil como extrabursátil) o título opcional (“Warrant”) de que se trate, especialmente aquéllas con modalidad de ejercicio tipo “Americana” y “Bermuda”. En caso de que en algún día hábil no exista al menos una operación con ejercicio, se deberá reportar un archivo “vacío” en esta sección.

Una vez que la institución reporte esta sección para una fecha particular, Banco de México entenderá que las operaciones que no fueron reportadas en el SAIF-Web llegaron a su término en esa fecha sin ser ejercidas.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al número asignado para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate.

2. ORIGEN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al origen de la operación ejercida y se deberá anotar:

P Cuando se trate de una posición propia.

T Cuando se trate de una posición por cuenta de una tercera persona (persona cliente); esta clave aplica exclusivamente para las operaciones de las Secciones I y III.

3. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso de que la operación ejercida sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 2), este campo mostrará la clave de la persona cliente (o tercera persona) o el Código LEI relativo a la operación ejercida a la fecha de vencimiento de que se trate. Si la operación ejercida es por cuenta propia deberá registrarse el Código LEI de la institución (el mismo registrado en el campo “11 - Código LEI de la Institución”).

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo se refiere a la fecha de concertación de la operación que fue ejercida.

5. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Se deberá anotar la clave de la sección (1, 2, 3 o 9) a que corresponda la operación que fue ejercida.

6. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

En el caso de la Sección II o Sección IX, este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación que fue ejercida.

7. FECHA DE EJERCICIO DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la fecha en que la opción de que se trate fue ejercida, con formato AAAA/MM/DD.

8. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Tratándose de opciones cuyo contrato establezca el precio o tasa de ejercicio desde su fecha de concertación (incluye las opciones tipo “asiáticas” cuyo precio de ejercicio se conoce desde la fecha de concertación), este campo se debe reportar con “0” (cero).

Por su parte, en el caso de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación (por ejemplo, para las opciones tipo “lookback maxmin” o “lookback average”), en este campo se debe registrar el precio o tasa a la que la opción fue ejercida.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo. Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y decimales.

9. IMPORTE EJERCIDO EN LA OPERACIÓN

En el caso de operaciones de la Sección II y Sección IX, se deberá anotar el importe efectivamente pagado o recibido por el ejercicio de la opción de que se trate, en miles (redondeado) de unidades de la moneda de liquidación de que se trate. No obstante, si el importe ejercicio es mayor o igual a 0.45 (miles de unidades) y menor o igual a 1 (miles de unidades), debe redondearse a 1 (miles de unidades), si el ejercicio es menor a 0.45 (miles de unidades) y mayor a “0” (cero) debe reportarse los registros con un monto ejercido igual a “0” (cero). En particular, para las opciones que se liquiden por entrega “física” del subyacente, este importe corresponde a la parte relativa a la divisa o la moneda de liquidación. Por ejemplo, en el caso del ejercicio de una opción sobre títulos de deuda, en este campo debe reportarse el importe efectivamente pagado o recibido por la recepción o entrega, respectivamente, de dichos títulos.

En el caso de operaciones de la Secciones I y III, en este campo se debe reportar el número de contratos (en unidades) ejercidos en la fecha a la que se refiere el campo “7-Fecha de Ejercicio de la Opción”.

10. MONEDA DEL IMPORTE EJERCIDO EN LA OPERACIÓN

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

Uso Público

Información de acceso público.

11. 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 con la obligatoriedad que tienen las entidades que participan en el mercado de derivados señalada en el numeral 12 de la circular 4/2012.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

12. TIPO DE SUBYACENTE EJERCIDO

Tratándose de opciones cuyo subyacente sea una canasta de activos, se deberá reportar la clave del subyacente ejercido en la fecha de ejercicio reportada en el campo “7. Fecha de Ejercicio de la Opción”, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Por su parte, en el caso de operaciones cuyo contrato establezca un único activo subyacente objeto de la operación, este campo deberá reportarse vacío.

13. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Tratándose de opciones cuyo subyacente sea una canasta de activos, y cuyo subyacente ejercido en la fecha de ejercicio reportada en el campo “7. Fecha de Ejercicio de la Opción”, sea a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 12), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 12), c) un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 12), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 12), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 12), o f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 12), se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente 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 subyacente sea distinto de los mencionados títulos en el párrafo anterior, o en el caso de operaciones cuyo contrato establezca un único activo subyacente, este campo deberá ser igual a vacío.

14. VALOR DEL SUBYACENTE

Se deberá reportar el valor final del subyacente utilizado para el cálculo del valor intrínseco de la opción, en unidades (con enteros y 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 con enteros y decimales.

15. FORMA DE LIQUIDACIÓN

En el caso de operaciones reportadas en la Sección IX cuyo valor del campo 17 (“Forma de liquidación”) sea igual a la clave “M”, en este campo se deberá reportar la forma de liquidación realizada en la fecha de ejercicio correspondiente (campo 7 de esta sección). En caso contrario, este campo deberá reportarse vacío.

16. IMPORTE EJERCIDO PARCIAL

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

En su caso, se deberá anotar el importe ejercido anticipadamente (en la fecha señalada en el campo 7) en forma parcial de la operación de que se trate, en miles (con decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

En el caso que la operación haya sido ejercida en su totalidad, se deberá anotar “0” (cero) en este campo y dicho importe deberá reportarse en el campo 9 de esta sección.

Adicionalmente, en el caso de operaciones de la Secciones I y III, en este campo se deberá reportar el número de contratos (en unidades) ejercidos parcialmente en la fecha a la que se refiere el campo “7. Fecha de Ejercicio de la Operación”.

17. 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 o IX del formulario de OPTO. Adicionalmente, si la operación corresponde a la Sección I o III, este campo deberá reportarse “vacío”.

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

Sección VI.- Información sobre la “Convalidación” de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en Mercados Reconocidos.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al número asignado para estos efectos por Banco de México a la institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate.

2. ORIGEN DE LA POSICIÓN

Este campo se refiere al origen de la posición vigente a la fecha de corte a confirmar, y se deberá anotar:

P Cuando se trate de una posición propia.

T Cuando se trate de una posición por cuenta de una tercera persona (persona cliente).

3. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso que la posición vigente sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 2), este campo mostrará la clave de la persona cliente (o tercera persona) o el Código LEI relativo a la posición vigente a confirmar. Si la posición vigente es por cuenta propia se mostrará el Código LEI de la institución (la misma registrada en el campo 15).

4. FECHA DE CORTE

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda la posición vigente a confirmar, sobre una determinada pizarra y con un mismo socio liquidador (es decir, considerando todas las operaciones de cierre de posición negociadas hasta la fecha de corte).

5. POSICIÓN POR PIZARRA

En este campo se deberá anotar:

- E** Cuando la posición vigente (a la fecha del campo 4), para la pizarra y socio liquidador respectivos, corresponda a una posición “corta” (es decir, pizarras relativas a Emisión).
- A** Cuando la posición vigente (a la fecha del campo 4), para la pizarra y socio liquidador respectivos, corresponda a una posición “larga” (es decir, pizarras relativas a Adquisición).

6. CLAVE DE PIZARRA

Este campo se refiere a la “clave de pizarra” de la posición vigente a confirmar, para un determinado socio liquidador (campo 7). En el caso de pizarras negociadas en mercados distintos al “Mexder”, esta clave incorporará, al final de la misma y después de un guion “-”, el precio de ejercicio pactado en la(s) operación(es) con posición “abierta” vigente a la fecha relativa al campo 4. Adicionalmente, para pizarras negociadas en mercados distintos al “Mexder”, si el precio de ejercicio contiene un punto “.”, éste deberá substituirse por un guion.

7. SOCIO LIQUIDADOR

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada “Socio Liquidador” que corresponda a la posición vigente en una determinada “clave de pizarra” (campo 6).

8. NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES (ABIERTOS) EN POSICIÓN

Este campo se refiere al número de contratos abiertos de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” (campo 6) y socio liquidador (campo 7) de que se trate.

9. OBJETIVO DE LA POSICIÓN

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

10. LA POSICIÓN ES PARTE DE UN “PAQUETE”, CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B

En caso que la posición vigente (cuyo subyacente sea una tasa de interés) se pueda considerar como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, se deberá anotar un “1” en este campo.

Sí la posición vigente no es considerada como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B., se deberá anotar “0” (cero).

11. VALOR DE LA VOLATILIDA IMPLÍCITA

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Se deberá anotar el valor de la volatilidad implícita (en términos porcentuales y en unidades) en el precio de mercado de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” del campo 6, calculada a la fecha de corte que corresponda (campo 4).

12. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” (en términos de probabilidad y hasta dos decimales) de la de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” del campo 6, calculado a la fecha de corte que corresponda (campo 4).

13. IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la de la posición vigente, relativa a la “clave de pizarra” del campo 6, 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.

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

Se deberá anotar la clave o folio de identificación del contrato de garantía relativo a la posición vigente de que se trate. Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la Sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

15. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Secciones VII.- Información sobre la “Convalidación” de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en Mercados No Reconocidos.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al número asignado para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate.

2. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo se refiere a la fecha de concertación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 5).

3. FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda la operación vigente a confirmar.

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 5).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5. 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.

6. VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA

Se deberá anotar el valor de la volatilidad implícita (en términos porcentuales y en unidades) en el precio de mercado de la opción vigente de que se trate, calculada en la fecha de corte que corresponda (campo 3).

7. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” (en términos de probabilidad y hasta dos decimales) de la opción vigente de que se trate, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3).

8. LA OPERACIÓN ES PARTE DE UN “PAQUETE”, CONFORME A LA C.U.B. O LA C.U.C.B

En caso que la operación individual (cuyo subyacente sea una tasa de interés) se pueda considerar como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, se deberá anotar un “1” en este campo.

Sí la operación no es considerada como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B., se deberá anotar “0” (cero).

9. CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B., o en el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 8), se deberá anotar una clave o folio que sirva para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte del mismo “paquete”. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinado “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 8), en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

10. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B., o en el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 8), 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 un mismo “paquete”. Cada grupo de operaciones relativas a un determinado “paquete”, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

Uso Público

Información de acceso público.

Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma fecha de corte (campo 3) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un “paquete” (campo 9).

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B. (“0” en el campo 8), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

11. IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)

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 3) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

12. CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR LOS ACTIVOS QUE CONSTITUYEN LA GARANTÍA DE LA OPERACIÓN

En caso que el contrato relativo a la opción 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 al formulario OPTO.

Tratándose de operaciones cuyo contrato no contemple el otorgamiento de garantías, este campo deberá ser igual a “SG” (Sin Garantía).

13. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

14. 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 OPTO.

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

Sección VIII.- Información sobre la “Convalidación” de operaciones con Títulos Opcionales “Warrants” vigentes a la fecha de corte.

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo se refiere al número asignado para estos efectos por Banco de México a la institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate.

2. ORIGEN DE LA POSICIÓN

Este campo se refiere al origen de la posición vigente en el título opcional (“Warrant”), a la fecha de corte a confirmar, y se deberá anotar:

P Cuando se trate de una posición propia.

T Cuando se trate de una posición por cuenta de una tercera persona (persona clienta).

3. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

En caso que la posición vigente, en el título opcional (“Warrant”) de que se trate, sea por cuenta de una tercera persona (clave “T” en el campo 2), este campo mostrará la clave de la persona clienta (o tercera persona) o el Código LEI relativo a la posición vigente a confirmar. Si la posición vigente es por cuenta propia se mostrará la el Código LEI (la misma registrada en el campo 12).

4. FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda al título opcional (“Warrant”) en posición.

5. CLAVE DEL TÍTULO OPCIONAL

Este campo se refiere a la “clave” del título opcional (“Warrant”) en posición a la fecha de corte de que se trate (campo 4), conforme al “Catálogo de Títulos Opcionales” a que se refiere el Anexo AB.

6. NÚMERO DE TÍTULOS OPCIONALES EN POSICIÓN

Este campo se refiere al número de títulos en posición total (a la fecha del campo 4), para la clave de título opcional (campo 5) de que se trate.

7. OBJETIVO DE LA POSICIÓN

Se deberá anotar el objetivo que corresponda al título opcional (“Warrant”) en posición a la fecha de corte de que se trate, conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

8. VALOR DE MERCADO DE LOS TÍTULOS OPCIONALES EN POSICIÓN

Se deberá anotar el valor de razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la posición total en el título opcional de que se trate, al fin de mes a confirmar (campo 4). Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

9. VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA

Se deberá anotar el valor de la volatilidad implícita (en términos porcentuales y en unidades) en el precio de mercado del título opcional en posición de que se trate, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 4).

Uso Público

Información de acceso público.

10. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” (en términos de probabilidad, y en unidades y hasta dos decimales) del título opcional en posición de que se trate, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 4).

11. IMPORTE ACTUALIZADO DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el importe de la prima total actualizado a la fecha de corte (campo 4) que corresponda al título opcional en posición de que se trate (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales). Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la CNBV.

12. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección IX.- Operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos.

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. 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.

3. 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.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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

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

6. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE EJERCICIO

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Americana” o “Bermuda” (claves “A” y “B” en el campo 13), se deberá anotar, la fecha de inicio del período de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Europea” (clave “E” en el campo 13), esta fecha deberá ser la misma que la de concertación (campo 5).

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), está fecha corresponde al inicio del primer periodo de ejercicio (por ejemplo, del “Caplet” o “Floorlet”) de la operación de que se trate.

7. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE EJERCICIO, O FECHA ÚNICA DE EJERCICIO

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Americana” o “Bermuda” (claves “A” y “B” en el campo 13), se deberá anotar, la fecha de término del período de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones con un solo ejercicio posible y liquidación tipo “Europea” (clave “E” en el campo 12), se deberá anotar, la fecha única de ejercicio, con formato AAAA/MM/DD.

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), está fecha corresponde al término del último periodo de ejercicio posible (por ejemplo, del “Caplet” o “Floorlet”) de la operación de que se trate.

8. OTRO TIPO DE DERIVADO VINCULADO AL CONJUNTO DE OPCIONES

Se deberá anotar la clave que corresponda a los tipos de derivados que forman parte de la estructura y que sean distintos a opciones, conforme al “Catálogo de Derivados” a que se refiere el Anexo AJ. Por ejemplo, en el caso de un “Swaption”, se deberá reportar la clave “2” (“La opción tiene como subyacente contrato(s) de Swap”) y el Swap implícito en la estructura deberá reportarse en el formulario “SWAPS”.

9. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN

En el caso de operaciones con un solo ejercicio posible, se deberá anotar, el número de días hábiles, posteriores a la fecha de ejercicio único, para liquidar la operación de que se trate.

En el caso de operaciones con múltiples ejercicios posibles (como los “Caps” y “Floors”), donde el número de días hábiles posteriores a cada fecha de ejercicio sea diferente (del “Caplet” o “Floorlet”), se deberá reportar el Complemento de la Sección IX indicando para cada fecha de ejercicio el número de días hábiles posteriores para liquidar la operación.

Uso Público

Información de acceso público.

En caso que la liquidación se realice en la misma fecha en que la operación es ejercida, se deberá reportar “0” (cero) en este campo.

10. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- | | |
|----------|---|
| E | Cuando la Institución emita la opción. |
| A | Cuando la Institución adquiera la opción. |

11. TIPO DE OPCIÓN

Se deberá anotar:

- | | |
|-----------|--|
| C | En el caso de opciones de compra (“Call”). |
| V | En el caso de opciones de venta (“Put”). |
| OC | En el caso de opciones “binarias” o “digitales” de compra (opción digital tipo “Call”). |
| OV | En el caso de opciones “binarias” o “digitales” de venta (opción digital tipo “Put”). |
| CH | En el caso de opciones que a una fecha determinada puedan ser de compra (“Call”) o de venta (“Put”). |

12. TIPO DE OPCIÓN DOS

En el caso que una estructura contemple dos tipos de opciones, siempre y cuando sean de la misma naturaleza, es decir, dos opciones digitales o dos opciones distintas a digitales, se deberá anotar:

- | | |
|-----------|--|
| C | En el caso de opciones de compra (“Call”). |
| V | En el caso de opciones de venta (“Put”). |
| OC | En el caso de opciones “binarias” o “digitales” de compra (opción digital tipo “Call”). |
| OV | En el caso de opciones “binarias” o “digitales” de venta (opción digital tipo “Put”). |
| CH | En el caso de opciones que a una fecha determinada puedan ser de compra (“Call”) o de venta (“Put”). |

Asimismo, se considerará que los dos tipos de opciones reportadas en el campo 11 y 12 tendrán la misma modalidad al ejercicio (campo 13), mismo importe base (campo 15), forma de liquidación (campo 17 y 18), condición de terminación anticipada o cancelación del pago del flujo (campo 38 y 39), características del subyacente (campo 49 a 53) y número de ejercicios iguales (campo 51 y 54).

En caso que la estructura no contemple otro tipo de opción, este campo deberá ser vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

13. MODALIDAD DEL EJERCICIO

Se deberá anotar:

- A** En el caso de opciones con tipo de ejercicio “Americana” (cualquier día hábil dentro de la fecha de inicio y de término del periodo de ejercicio).
- E** En el caso de opciones con tipo de ejercicio “Europea” (exclusivamente en la fecha de término del periodo de ejercicio).
- B** En el caso de opciones con tipo de ejercicio estilo “Bermuda” (cualquier día hábil de un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas, dentro de la fecha de inicio y de término del periodo de ejercicio).

En caso de opciones con modalidad de liquidación Bermuda, se deberá reportar el Complemento de la Sección IX indicando los periodos de posible ejercicio.

14. 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.

15. IMPORTE BASE O DE REFERENCIA

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo contrato establezca explícitamente el importe base o de referencia, se deberá reportar dicho valor en miles de unidades (con decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato (campo 16).

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo contrato no establezca explícitamente el importe base o de referencia, este campo debe ser igual al producto del campo 57 (número de unidades del subyacente) por el campo 59 (Precio unitario) dividido entre mil.

En el caso de opciones “binarias” o “digitales” (“todo o nada”), se deberá anotar el importe fijo correspondiente, en miles de unidades (con decimales) de la moneda de denominación establecida en el contrato (campo 16).

En el caso de opciones con más de un ejercicio, por ejemplo, para las operaciones tipo “Cap”, se deberá reportar el importe base del primer cupón o periodo de ejercicio. Asimismo, en caso que dicho importe base se modifique durante la vida de la operación, se deberá reportar el complemento a dicha operación (Sección IX complemento).

16. MONEDA DEL IMPORTE BASE O DE REFERENCIA

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base (del campo 15) de la operación, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una divisa (claves de la “32” a la “986” en el campo 49), tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 49) o tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 49), se deberá anotar la clave de la

Uso Público

Información de acceso público.

moneda en que está expresado el importe base respectivo (campo 15), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En el caso de opciones “binarias” o “digitales” (“todo o nada”), se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe fijo respectivo (campo 15).

17. FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación tenga que ser liquidada mediante entrega del subyacente.
- D** Cuando la operación tenga que ser liquidada “por diferencias” o en efectivo.
- M** Cuando la operación pueda liquidarse por entrega del subyacente o por diferencias, a solicitud de la contraparte.

En caso de reportar la clave “M”, en la Sección V a la fecha de ejercicio correspondiente, se deberá reportar la forma de liquidación final ya sea por entrega del subyacente “S” o por diferencias “D”.

18. MONEDA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar la clave de la moneda con que se liquidará el subyacente o, en su caso, “la diferencia”, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

19. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave “8”), se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a recibir y/o a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 20 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

20. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave “8”), se deberá anotar la fecha de vencimiento “hábil” o “inhábil”, según corresponda, de acuerdo con la clave reportada en el campo “21. Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses, del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

21. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), en este campo se deberá informar el procedimiento establecido en el contrato de la operación de que se trate, para ajustar la fecha de vencimiento de cada flujo en caso que ésta sea día inhábil; conforme al "Catálogo de Convención de Días Inhábiles para el Cálculos de los Flujos" a que se refiere el Anexo I.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

22. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), se deberá anotar el número total de flujos a recibir y/o a entregar pactados en la operación.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

23. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), se deberá anotar el tamaño de los flujos a recibir y/o entregar de la operación (con enteros y sin decimales), expresado en número de días naturales. Con este intervalo se determina el periodo de cobro de cada flujo a recibir y/o entregar.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

24. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR O ENTREGAR.

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un

Uso Público

Información de acceso público.

contrato swap (campo 8 igual a la clave “8”), se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a recibir y/o entregar de la operación, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF.

Tratándose de operaciones que reciban y/o paguen tasa fija, se deberá anotar la clave “NA” (equivalente a no aplica).

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

25. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave “8”), se deberá anotar, en su caso, la frecuencia con la que se revisa o actualiza la tasa de referencia de la operación, expresada en número de días naturales. Por ejemplo, si para determinar la tasa de interés, la tasa de referencia se debe revisar o actualizar semanalmente, entonces en este campo deberá registrarse 7 (siete). Con este intervalo se calcula la tasa de interés con la que se determinan los intereses a recibir o entregar de cada flujo. En caso que la tasa de referencia se revise o actualice una vez durante cada flujo, este intervalo deberá ser igual al intervalo del flujo a recibir o entregar (campo 23).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

26. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (RECIBIR O ENTREGAR)

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave “8”), se deberá anotar:

- C** Cuando, y conforme al contrato de la operación, la fórmula para el cálculo del flujo a recibir y/o entregar requiera dividir los días efectivamente transcurridos entre 360 (días del año comercial).
- N** Cuando y conforme al contrato de la operación, la fórmula para el cálculo del flujo a recibir y/o entregar, requiera dividir los días efectivamente transcurridos entre 365 o 366, según corresponda (días del año natural).

Uso Público

Información de acceso público.

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

27. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), se deberá anotar, en su caso, la clave que corresponda a la modalidad con la cual la tasa de referencia se revisa, y se considera en la fórmula para determinar la tasa de interés de los flujos a recibir y/o entregar; conforme al "Catálogo de Modalidad de la Tasa de Referencia", a que se refiere el Anexo V. Cabe mencionar que, para este campo, una tasa compuesta es aquella que pudiera resultar del promedio de otras o de alguna otra forma que utilice más de una tasa para dar como resultado otra con la que se calcularán los intereses de los flujos a recibir.

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija, se deberá anotar la clave "NA" (No aplica).

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

28. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8") y cuando, conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la tasa variable a recibir o entregar de la operación (campo 24) se requiera multiplicar la "tasa de referencia" por un factor; en este campo se deberá anotar dicho factor, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso que la tasa variable sea igual al 75% de la TIIE a 28 días, en este campo se anotará "0.750000"

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 a 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

29. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), en caso que el contrato de la operación en la fórmula para obtener la tasa variable a recibir o entregar de la operación (campo 24) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de

Uso Público

Información de acceso público.

referencia); en este campo se deberán anotar los puntos porcentuales a sumar o a restar, según corresponda, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso que la tasa variable resulte de sumar 0.35% a la LIBOR-USD a 90 días, en este campo se anotará: "0.350000". Asimismo, en caso que la tasa variable resulte de restar 0.35% a la LIBOR-USD a 90 días, en este campo se anotará: "-0.350000"

En caso que el contrato de la operación no contenga una fórmula para obtener la "tasa variable a recibir y/o a entregar", este campo deberá ser igual a "0" (cero).

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

30. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR O ENTREGAR

En aquellas operaciones donde se intercambia una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap (campo 8 igual a la clave "8"), se deberá anotar, en su caso, la tasa fija a recibir y/o entregar anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 4.375%, se anotará: 4.375000.

Tratándose de operaciones que reciban tasa variable (campo 24 distinto de "NA"), este campo deberá ser igual a "0" (cero).

El valor de este campo deberá reportarse conjuntamente con los campos del 19 al 30.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nocional, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

31. CÁLCULO DE LIQUIDACION

Se deberá anotar la clave que corresponda al cálculo de liquidación, conforme al "Catálogo de Cálculo de liquidación" a que se refiere el Anexo AK. La clave seleccionada se utilizará conjuntamente con el campo "33. Factor aplicado a la liquidación" y el campo "59. Precio unitario o de ejercicio".

Por ejemplo, en caso de una estructura o estrategia cuyo pago de liquidación sea del tipo "vanilla", se deberá reportar la clave "2". Por otro lado, si el pago de liquidación es de tipo digital, se deberá reportar la clave "3" y el porcentaje aplicable al importe base se deberá reportar en el campo 33.

32. CÁLCULO DE LIQUIDACION DOS

En caso que exista una segunda forma de liquidación, se deberá anotar la clave que corresponda al cálculo de liquidación, conforme al "Catálogo de Cálculo de liquidación" a que se refiere el Anexo AK. La clave seleccionada se utilizará para el campo "35. Factor aplicado a la liquidación dos" y para el campo "64. Precio unitario o de ejercicio dos".

Uso Público

Información de acceso público.

En caso que no exista otra forma de liquidación diferente a la reportada en el campo “30. Cálculo de liquidación”, se deberá reportar el valor “1” (No aplica).

33. FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar, en su caso, el factor con enteros y hasta seis decimales que deberá multiplicar al resultado del Cálculo de Liquidación (campo 31). Por ejemplo, en caso de una opción digital que pague el 30% de un monto nocional, el valor de este campo deberá ser igual a “30” y el monto nocional deberá reportarse en el campo 15.

Tratándose de operaciones que no contemplen un factor este campo deberá ser igual a “100” (cien).

34. DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar, en su caso, el diferencial con enteros y hasta seis decimales que deberá sumar o restar al resultado del Cálculo de Liquidación (campo 31). Por ejemplo, en caso de una opción cuya liquidación resulte de multiplicar el importa base (campo 15) por el tipo de cambio pactado más un diferencial de .057, entonces en este campo se anotará: “0.057000”. Asimismo, en caso que el diferencial resulte de restar 0.057, entonces en este campo se anotará: “-0.05700”.

Tratándose de operaciones que no contemplen un diferencial este campo deberá ser igual a “0” (cero).

35. FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN DOS

Se deberá anotar, en su caso, el factor con enteros y hasta seis decimales que deberá multiplicar al resultado del “Cálculo de Liquidación Dos” reportado en el campo 32. Por ejemplo, en caso de una opción digital que pague 30% del monto nocional si ocurre la condición “x” y pague 40% sobre el monto nocional si ocurre la condición “y”, entonces se deberá reportar “30” en el campo 33, “40” en este campo y el monto nocional deberá reportarse en el campo 15.

Tratándose de operaciones que no contemplen un factor este campo deberá ser igual a “100” (cien).

En caso que en el campo “31. Cálculo de liquidación dos” se haya reportado la clave “1” (No aplica), el valor de este campo deberá ser igual a cero “0”.

36. DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN DOS

Se deberá anotar, en su caso, el diferencial con enteros y hasta seis decimales que deberá sumar o restar al resultado del Cálculo de Liquidación dos (campo 32). Por ejemplo, en caso de una opción cuya liquidación dos resulte de multiplicar el importa base (campo 15) por el tipo de cambio pactado más un diferencial de .057, entonces en este campo se anotará: “0.057000”. Asimismo, en caso que el diferencial resulte de restar 0.057, entonces en este campo se anotará: “-0.05700”.

Uso Público

Información de acceso público.

Tratándose de operaciones que no contemplen un diferencial en la segunda forma de liquidación este campo deberá ser igual a “0” (cero).

37. MEMORIA DEL PAGO

Se deberá anotar:

- S** Cuando los pagos o estructuras de pago tienen memoria durante toda la vida de la opción.
- P** Cuando los pagos o estructuras de pago tienen memoria durante periodos específicos de la vida de la opción.
- N** No aplica.

En caso que los cupones o estructuras de pago tengan memoria durante periodos específicos (clave “P” en este campo), se deberá reportar el Complemento de la Sección IX indicando los periodos donde aplique esta característica.

38. CONDICIÓN DE TERMINACIÓN ANTICIPADA O CANCELACIÓN DEL PAGO DEL FLUJO

Se deberá anotar la clave que corresponda a la terminación anticipada de la estructura, o la cancelación del pago del flujo conforme al “Catálogo Condición de terminación anticipada” a que se refiere el Anexo AL.

Por ejemplo, en caso de estructuras o estrategias que contemplen barreras tipo “Knock Out”, este campo deberá ser distinto de la clave “1”. Asimismo, en caso que la barrera tipo “Knock Out” deba ser alcanzada en más de una ocasión, la clave reportada en este campo deberá ser distinta a “1” y a “2”.

Adicionalmente, en caso que el valor de este campo sea distinto de la clave “1”, el campo “72. Modalidad del precio barrera” o el campo “78. Modalidad del precio barrera dos” deberá referirse al nivel de la(s) barrera(s) tipo “Out”.

39. NÚMERO DE OCURRENCIAS DE LA CONDICIÓN PARA LA TERMINACIÓN ANTICIPADA O CANCELACIÓN DEL PAGO DEL FLUJO

Se deberá anotar el número de ocasiones que debe cumplir la condición de terminación anticipada o cancelación del pago del flujo. Este campo deberá ser mayor a “1” (uno) en caso que el campo “38. Condición de terminación anticipada o cancelación del pago” sea distinto a “1” y a “2”.

Por ejemplo, en caso de una opción con barrera tipo “Knock Out” en la cual su contrato establece que se extinguirá en caso de que el activo subyacente toque una determinada barrera en tres ocasiones durante la vida de la operación, entonces el valor de este campo deberá ser igual a “3”; el valor de la barrera “Knock Out” deberá ser reportada en el campo 70 o 71 y el valor del campo 72 deberá ser igual “UO” o “DO” según corresponda. Asimismo, si el valor de la barrera “Knock Out” se reporta en el campo 76 o 77, entonces el valor del campo 78 deberá ser igual a igual “UO” o “DO” según corresponda.

Uso Público

Información de acceso público.

En caso que no exista una condición de terminación anticipada o cancelación del pago del flujo, es decir, que le campo 38 sea igual a “1”, el valor de este campo deberá ser igual a “0” (cero).

40. EXISTENCIA DE TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Se deberá anotar:

- S** Cuando la operación contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”). Esto sucede (en el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales”) cuando la moneda de liquidación es diferente de la moneda de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio). En el caso de operaciones “binarias” o “digitales”, esto puede suceder cuando la moneda del importe fijo es diferente de la moneda de liquidación.
- N** Cuando la operación (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) no contemple garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”); y, por tanto, la moneda de liquidación es igual a la moneda de denominación o de cotización del subyacente (distinto de divisas y tipos de cambio); o a la moneda del importe fijo correspondiente.

41. TIPO DE CAMBIO FORWARD “QUANTO”

Tratándose de operaciones (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) que contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “S” en el campo 40, se deberá anotar dicho tipo de cambio (expresado en unidades de la moneda de liquidación por unidad de la moneda del subyacente, con enteros y hasta seis decimales).

Tratándose de operaciones (incluyendo las opciones “binarias” o “digitales”) que no contemplen garantizar un tipo de cambio predeterminado (o “Quanto”), es decir con clave “N” en el campo 40, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

42. IMPORTE DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el importe total de la prima relativa a la operación, en miles (con decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato. En caso que la prima sea financiada durante la vida de la operación, se deberá reportar el importe total final a pagar por la operación.

Asimismo, en el caso de opciones en el que el valor de la prima sea distinto para cada cupón o periodo de ejercicio, se deberá reportar dicho valor en el complemento de la operación (Sección IX complemento) en el cupón o periodo de ejercicio que corresponda.

43. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA PRIMA

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el importe de la prima (campo 42), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

44. FECHA DE PAGO/COBRO DE LA PRIMA

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Se deberá anotar la fecha de pago o cobro de la prima de la operación, con formato AAAA/MM/DD. En caso de que no exista pago o cobro de prima, es decir, el campo 42 es igual a "0" (cero), el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

45. 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 y debe ser distinto de 90.

En particular, para las estructuras conocidas como "Call Spread" en caso que sea reportada utilizando un solo registro (campo 11 igual a "C" y campo 12 igual a vacío), el valor del este campo deberá ser igual a la clave 58 o 59 según se establezca en el contrato. Asimismo, para las estructuras conocidas como "Put Spread" en caso que sea reportada utilizando un solo registro (campo 11 igual a "V" y campo 12 igual a vacío), el valor del este campo deberá ser igual a la clave 60 o 61 según se establezca en el contrato. Por el contrario, en caso que dichas estructuras sean reportadas en dos registros, se deberá reportar la clave 21 o 22 según corresponda.

46. CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA "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.

En caso de que el campo 45 ("La operación es parte de una operación estructurada o paquete") sea igual a "90", este campo debe ser igual a "NA".

47. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "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 44).

48. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

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

Uso Público

Información de acceso público.

En particular, las opciones “implícitas” en notas, títulos, créditos, préstamos u otras “operaciones estructuradas” se deben identificar con la clave que corresponda a la operación o contrato anfitrión de que se trate (claves “50”, “51” o “52”), conforme a dicho “Anexo C”.

49. TIPO DE SUBYACENTE

Se deberá anotar la clave del subyacente objeto de la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (es decir, cualquier opción, incluyendo las “binarias” o “digitales”, sobre divisas que se liquide por diferencias), en este campo se debe registrar la clave “TIC”, mientras que en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se deberá reportar la clave que corresponda al tipo de cambio de la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo “17. Forma de Liquidación” se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias) o la clave “M” (cuando la operación pueda liquidarse por entrega física o por diferencias).

En el caso de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” sobre divisas (es decir, opciones sobre divisas que se liquiden por entrega física), en este campo se debe reportar la clave (conforme al Anexo F) de la divisa a recibir, en el caso de compras, o la divisa a entregar, en el caso de ventas. Por su parte, en el campo “17. Moneda de liquidación” se deberá registrar la clave de la divisa con la que se liquidará la operación de que se trate. Adicionalmente, en dicho campo 17 se debe reportar la clave “S” (relativa a liquidación por entrega del subyacente) o la clave “M” (cuando la operación pueda liquidarse por entrega física o por diferencias).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una tasa de interés, en este campo se debe registrar la clave “TIM”, cuando la tasa de interés sea cotizada en México (por ejemplo, la TIIE), o la clave “TIX”, cuando la tasa de interés sea cotizada del extranjero (por ejemplo, la LIBOR). Asimismo, en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda a la tasa de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “17. Forma de Liquidación” se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre una acción o título representativo de capital, en este campo se debe registrar la clave “ACM”, cuando dicha acción sea de una empresa residente en México, o la clave “ACE”, cuando dicha acción sea de una empresa residente del extranjero. Asimismo, en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda a la acción o título representativo de capital de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un índice accionario, en este campo se debe registrar la clave “IAM”, cuando dicho índice sea cotizado en la Bolsa Mexicana de Valores, o la clave “IAX”, si el índice es cotizado en alguna bolsa de valores del extranjero. Asimismo, en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda al índice de que se trate, conforme al Anexo AF.

Uso Público

Información de acceso público.

Adicionalmente, en el campo 17 se debe registrar la clave “D” (relativa a liquidación por diferencias).

En el caso de operaciones sobre un título de deuda, en este campo se debe registrar la clave “TDM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TDE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente del extranjero. Asimismo, en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave que corresponda al título de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un título referenciado (incluyendo los certificados bursátiles fiduciarios o “Exchange Traded Funds” o “ETF’s”), en este campo se debe registrar la clave “TRM”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en México, o la clave “TRE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente del extranjero. Asimismo, en el campo “50. Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio” se debe reportar la clave correspondiente al título referenciado de que se trate, conforme al Anexo AF.

50. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 49), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 49), c) un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 49), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 49), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 49), f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 49), o g) canastas de los subyacentes mencionados en incisos anteriores, se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente 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 subyacente sea distinto de los mencionados títulos, índices accionarios, tasas de interés, o tipos de cambio, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

51. INTERVALO O FRECUENCIA DE LOS POSIBLES EJERCICIOS

En el caso de operaciones cuya modalidad de ejercicio se realice en distintas fechas únicas pre-establecidas durante la vida de la operación, se deberá anotar la frecuencia con la que se puede ejercer la opción, expresada en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia del ejercicio es semanal, entonces en este campo deberá registrarse 7 (siete).

En el caso de “paquetes de opciones”, tales como los “Caps” o “Floors” (cuyo subyacente es una tasa de interés), en donde existen una serie de fechas de ejercicio únicas, se deberá anotar el tamaño promedio del intervalo de los posibles ejercicios (por ejemplo, de los “caplets” o “floorlets”) en el contrato de que se trate, expresado en número de días naturales, es decir, si el tamaño promedio del intervalo de los posibles ejercicios es cada 28 días, entonces en este campo deberá registrarse ese número. Este campo aplica de igual forma a los “paquetes de opciones” conocidos como “Corridor” o “Range Accrual”, en los cuales existan dos o más fechas únicas de posibles ejercicios y liquidación.

Uso Público

Información de acceso público.

Asimismo, si la modalidad de ejercicio es tipo “Bermuda” (clave “B” en el campo 13) donde el ejercicio puede ser en cualquier día hábil dentro del intervalo de periodos de fechas pre-establecidas y no continuas, se deberá anotar la frecuencia con la que se puede ejercer la opción y el intervalo de ejercicio correspondiente deberá reportarse en el Complemento de la Sección IX indicando los periodos de posible ejercicio. Por ejemplo, si una opción tipo “Bermuda” es tal que puede ser ejercida cada tres meses en un intervalo de 10 días por tres ocasiones, entonces en este campo deberá registrarse “90”, en el campo 54 deberá registrarse “3” (tres) y en el complemento de la Sección IX deberá reportarse las fechas de inicio y de vencimiento del periodo de cada posible ejercicio cuyo plazo deberá ser igual a diez días.

En el caso de operaciones con un solo evento de ejercicio se debe anotar “0” (cero).

52. INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL PRECIO DEL SUBYACENTE

En el caso de operaciones distintas a “paquetes de opciones”, por ejemplo, las “binarias”, “digitales”, de “barrera” o “toque”, en donde el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” para determinar si se paga o no, o se activa o desactiva; se deberá anotar la frecuencia con la que se monitorea el precio del subyacente respectivo, expresado en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia de monitoreo es discreta de forma diaria o semanal, entonces en este campo deberá registrarse 1 (uno) o 7 (siete). Por otro lado, si la frecuencia de monitoreo es continua, es decir, se trata de una opción con modalidad de ejercicio tipo Americana (campo 12 igual a la clave “A”), entonces en este campo deberá registrarse 0 (cero).

Por su parte, en el caso de “paquetes de opciones”, tales como los “Caps”, “Floors” o “Range Accrual”, en donde existen una serie de fechas de posibles ejercicios, se deberá anotar el tamaño promedio del intervalo con el que se monitorea el valor de mercado del subyacente, para determinar de cada uno de los posibles ejercicios. Si en cada fecha de monitoreo y posible ejercicio se liquida el importe correspondiente, entonces el valor de este campo debe ser igual al campo “51. Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios”.

En el caso de operaciones con ejercicio único y modalidad de ejercicio “europea”, o distintos a las anteriores, se debe anotar “0” (cero).

53. NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DEL SUBYACENTE

En caso de operaciones cuyo contrato establezca que el precio del subyacente se determina a través de una fórmula, se deberá anotar el número de días que se deberá utilizar para el cálculo del valor final del subyacente. Por ejemplo, para las opciones tipo “Asiática” (campo 62 o 67 igual a la clave “4”), se deberá anotar el número de días utilizado para el cálculo del promedio para obtener el valor final del subyacente.

Si el precio final del subyacente se determina con la observación del subyacente en la fecha de vencimiento, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

54. NÚMERO TOTAL DE POSIBLES EJERCICIOS

En el caso de “paquetes de opciones” (es decir, un contrato con múltiples opciones, tal como los “Caps”, “Floors”, “Corridor” o “Range Accrual”), en donde existen una serie de fechas de

Uso Público

Información de acceso público.

ejercicio, se deberá anotar el número total de fechas posibles de ejercicio en el contrato de que se trate (en unidades sin decimales). En el caso de operaciones con un solo evento de ejercicio, se debe anotar “1” (uno).

55. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE O VINCULADA AL CONJUNTO DE OPCIONES

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una Operación Derivada o que el “paquete” esté conformado por otras Operaciones Derivadas, distintas a opciones (campo 8 distinto a “1”), en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en los formularios “OFF” o “SWAPS”, según corresponda. Por ejemplo, en el caso de un “Swaption” (campo 8 igual a “2”), el valor de este campo deberá ser igual al valor del número de identificación reportado en el formulario “SWAPS”.

Tratándose de operaciones (incluyendo las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente no sea una operación derivada, este campo debe reportarse “vacío”.

56. SECCIÓN DEL FORMULARIO “SWAPS” A LA QUE PERTENECE LA OPERACIÓN SWAP

Tratándose de operaciones (distintas a las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente sea una operación derivada Swap o que el “paquete” esté conformado por un Swap, se deberá anotar la Sección del formulario “SWAPS” a la que pertenece dicha Operación Derivada, utilizando las claves “2”, “3” o “4” según corresponda.

Tratándose de operaciones (incluyendo las “binarias” o “digitales”) cuyo subyacente no sea una operación derivada Swap, este campo debe reportarse “vacío”.

57. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE

Tratándose de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, se deberá anotar el número de unidades del subyacente de que se trate, considerando la unidad de cotización internacional que corresponda. Por ejemplo, onzas para oro y plata, “bushels” para maíz, trigo, avena y soya, unidades de índice para índices accionarios, etc.

Tratándose de los subyacentes mencionados en el párrafo anterior y que la carta confirmación no mencione explícitamente el número de unidades del subyacente sino únicamente el importe base o de referencia (campo 15), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

58. MONEDA DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar la clave de la moneda en que este denominado, o se cotice internacionalmente (por ejemplo, dólares de los E.U.A., para oro y plata), el subyacente (campo 49), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 49), la clave de este campo debe corresponder a la moneda que aparezca en los tres primeros caracteres de la clave correspondiente del campo 50 (Por ejemplo, si el campo 50 tiene la clave “GBPEUR”, entonces en este campo se debe anotar la clave “826”, relativa a Libras Esterlinas).

59. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en su fecha de concertación, en este campo se deberá anotar el precio por unidad de subyacente (en su caso, conforme a la unidad de cotización internacional que corresponda; por ejemplo, onzas para oro y plata) 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 con 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 con decimales.

En el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45), o cualquier otra; se deberá reportar “0” (cero) en este campo y el valor del campo 60 deberá ser distinto de la clave “1”.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina como un porcentaje del precio del subyacente a la fecha de concertación (campo 69), dicho porcentaje deberá reportarse en este campo con enteros y con decimales.

Asimismo, tratándose de operaciones tipo “binaria” o “digital”, el valor de este campo deberá ser igual a “0” (cero).

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 59 a 63.

60. FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO.

Se deberá anotar la clave de la forma en que está expresado el precio de ejercicio reportado en el campo 59, de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Tipo de precio” a que se refiere el Anexo AM.

En caso de operaciones sobre índices se deberá reportar la clave “4” referente a puntos. Por otro lado, en caso que el campo 59 haya sido reportado como porcentaje del precio inicial del subyacente (campo 69) este campo deberá ser reportado con la clave “3”.

Asimismo, en el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45), el valor este campo deberá ser igual distinto a la clave “1”.

Uso Público

Información de acceso público.

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 59 a 63.

61. MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Tratándose de operaciones distintas al tipo “binaria” o “digital”, se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio (campo 59); o en su caso, el precio de la barrera superior o inferior, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E). Por lo tanto, si el campo 59 es igual a “0” (cero) y alguno o los dos campos 70 y 71 es mayor a “0” (cero), entonces el valor reportado en este campo corresponderá a la clave de la moneda en que está expresado el precio de la barrera superior y/o el precio de la barrera inferior respectivamente.

Adicionalmente, en el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45) y cuyo valor del campo 59 fue reportado con valor “0”, en este campo se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio a determinar en el futuro, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Asimismo, tratándose de operaciones tipo “binaria” o “digital”, el valor reportado en este campo corresponderá a la clave de la moneda en que está expresado el precio de la barrera superior y/o el precio de la barrera inferior (campo 70 y 71 respectivamente).

En el caso en que la forma del precio de ejercicio haya sido reportada como porcentaje del precio inicial del subyacente (campo 69) este campo se referirá a la moneda del precio inicial del subyacente.

62. CÁLCULO APLICABLE AL PRECIO DEL SUBYACENTE PARA DETERMINAR EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN

Se deberá anotar la clave del cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de las opciones de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Cálculo de Ejercicio” a que se refiere el Anexo AN.

Por ejemplo, tratándose de operaciones tipo “Asiática”, el valor de este campo deberá ser igual a la clave “4” y en el campo 53 se deberá reportar el número de días utilizado para el cálculo del promedio del valor final del subyacente.

63. NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DE EJERCICIO

En caso de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45), se deberá anotar el número de días que se deberá utilizar para el cálculo del precio o tasa de ejercicio reportado en el campo 60.

Si el precio o tasa de ejercicio se determina en la fecha de concertación, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 59 a 62.

Asimismo, es importante señalar que el número de días utilizado para el monitorear el precio del subyacente debe ser reportado en el campo 53.

64. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca un segundo precio unitario o tasa de ejercicio determinado en su fecha de concertación, en este campo se deberá anotar el precio por unidad de subyacente (en su caso, conforme a la unidad de cotización internacional que corresponda; por ejemplo, onzas para oro y plata) 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 con 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 con decimales.

En el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio se determina en una fecha posterior a su concertación (por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45), se deberá registrar “0” (cero).

Asimismo, tratándose de operaciones tipo “binaria” o “digital”, se debe registrar “0” (cero). Por otro lado, en el caso de estructuras que sean reportadas en un solo registro, cuyo precio de ejercicio sea el mismo para los dos tipos de opciones (campo 11 y 12), el valor de dicho precio de ejercicio deberá ser reportado tanto en el campo 59 como en este campo. Por ejemplo, la estructura por nombre “Straddle” (campo 45 igual a “19”), tiene la característica de tener el mismo precio de ejercicio para las opciones de Compra y Venta (campo 11 y 12) que la conforman, por lo tanto, el mismo precio de ejercicio deberá ser reportado tanto en el campo 59 como en este campo.

Este campo está referenciado a los campos 64 al 68.

Finalmente, tratándose de operaciones cuyo contrato no establezca un segundo precio unitario o tasa de ejercicio, este campo deberá ser igual a “0” (cero) y el campo 65 deberá ser igual a la clave “1”.

65. FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO DOS

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca un segundo precio unitario o tasa de ejercicio, se deberá anotar la clave de la forma en que está expresado el precio de ejercicio dos (campo 64), de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Tipo de precio” a que se refiere el Anexo AM.

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 64 a 68.

66. MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Tratándose de operaciones distintas al tipo “binaria” o “digital”, cuyo contrato establezca un segundo precio unitario o tasa de ejercicio, se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio dos; o en su caso, el precio de la barrera superior dos o inferior dos, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E. Por lo tanto, si el campo 64 es igual a “0” (cero), el campo 65 es igual a “1” (No aplica) y alguno o los dos campos 76 y 77 es mayor a “0” (cero), entonces el valor reportado en este campo corresponderá a la clave de la moneda en que está expresado el precio de la barrera superior dos y/o el precio de la barrera inferior dos respectivamente.

Adicionalmente, en el caso de operaciones (distintas a las binarias o digitales) cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio dos (campo 64) se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45) y cuyo valor del campo 64 fue reportado con valor “0”, en este campo se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio dos a determinar en el futuro, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Asimismo, tratándose de operaciones tipo “binaria” o “digital”, cuyo contrato establezca un segundo precio de la barrera superior y/o inferior, el valor reportado en este campo corresponderá a la clave de la moneda en que están expresado los campos 76 y/o 77 respectivamente.

Tratándose de operaciones cuyo contrato no establezca un segundo precio unitario o tasa de ejercicio, se deberá reportar la clave “0” (cero).

67. CÁLCULO APLICABLE AL PRECIO DEL SUBYACENTE PARA DETERMINAR EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN DOS

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca un segundo cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de las opciones, se deberá anotar la clave de la forma en que se determinará el nivel del subyacente para determinar el ejercicio de las opciones de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Cálculo de Ejercicio” a que se refiere el Anexo AN, de lo contrario deberá ser igual a “0” (No aplica).

68. NÚMERO DE DÍAS UTILIZADO PARA LA DETERMINACIÓN DEL PRECIO DE EJERCICIO DOS

En caso de operaciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio dos (campo 64) se determina en una fecha posterior a su concertación, por ejemplo, para las opciones tipo “lookback max” (clave “10” del campo 45), “lookback min” (clave “55” del campo 45) o “lookback average” (clave “11” del campo 45), se deberá anotar el número de días que se deberá utilizar para el cálculo del precio o tasa de ejercicio dos reportado en el campo 64.

Si el precio o tasa de ejercicio dos se determina en la fecha de concertación, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Este campo está referenciado a los campos 64 al 67.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un segundo precio de ejercicio, este campo deberá ser vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

69. PRECIO INICIAL DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar el precio inicial del subyacente en unidades (con enteros y con decimales) de acuerdo a la proveedora de precios y hora establecida en el contrato. En caso que el precio de ejercicio (campo 59 o 64) se encuentre expresando en términos porcentuales (clave “3” del campo 60 o 65), entonces el valor de este campo será utilizado para calcular el valor nominal de dicho precio de ejercicio.

70. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un precio o tasa superior, a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o paga o no, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y con decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 61). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y con decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y con decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa superior, se debe registrar “0” (cero).

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 71 a 75.

71. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un precio o tasa inferior, debajo de la cual la operación se “activa”, “desactiva” o “paga”, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y con decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 61). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y con decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y con decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa inferior, se debe registrar “0” (cero).

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 70 a 75.

72. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA

En el caso de opciones que se activen o desactiven si el precio de mercado o el nivel del subyacente toca o pasa el (los) precio(s) barrera se deberá anotar la clave conforme al “Catálogo Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO.

Este campo está ligado a los campos 70 y 71.

Uso Público

Información de acceso público.

Por ejemplo, en caso que el valor del campo 70 y 71 sean mayor a cero y que el valor de este campo sea igual a la clave “UI”, “DI”, “UIP” o “DIP”, se entenderá que la opción se “activa” o “paga” en caso que el precio de mercado del subyacente se encuentre dentro de los precios barrera reportados en el campo 70 y 71 respectivamente.

Por otro lado, en caso que el valor del campo 70 y 71 sean mayor a cero y que el valor de este campo sea igual a la clave “UO”, “DO”, “UOP” o “DOP”, se entenderá que la opción se “desactiva” o “no paga” en caso que el precio de mercado del subyacente se encuentre dentro de los precios barrera reportados en el campo 70 y 71 respectivamente.

Asimismo, si la clave reportada en este campo se refiere a una modalidad “Out” y el valor del campo “83. Callable” es distinto de “N”, se entenderá que el precio barrera reportado, ya sea en el campo 70 y/o 71, será la referencia para la terminación anticipada de la totalidad del contrato.

73. INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA

En el caso de operaciones en dónde el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” de forma continua (estilo americano) o en fechas específicas (estilo europeo) para determinar si las barreras se activan o desactivan se deberá anotar la frecuencia con la que se monitorea el precio del subyacente respectivo, expresado en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia de monitoreo de las barreras es diaria o trimestral, entonces en este campo deberá registrarse “1” (uno) o “90” (noventa) respectivamente.

En el caso de operaciones sin barreras, es decir, que el campo 72 haya sido reportado con clave “N”, entonces se debe anotar “0” (cero).

Por otro lado, si la frecuencia de monitoreo del o de los precios barrera es continua, entonces en este campo deberá registrarse 0 (cero).

Asimismo, en el caso en que el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” de estilo “Bermuda”, es decir, existan un conjunto de periodos de fechas pre-establecidos y no continuos de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar la frecuencia con la que comienza cada intervalo de monitoreo.

Asimismo, este campo está asociado a los campos 70, 71 y 72.

74. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA

Tratándose de operaciones que durante el periodo de ejercicio exista un monitoreo de los precios barrera (campo 70 y 71) tipo Bermuda, es decir, existan un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas de monitoreo de los precios barrera, se deberá anotar la fecha de inicio de dicho periodo, con formato AAAA/MM/DD. En caso de operaciones con más de un periodo de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar el complemento de la Sección IX indicando los periodos de monitoreo de los precios barrera para cada periodo de ejercicio correspondiente. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 70 a 75.

75. FECHA DE VENCIMIENTO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA

Tratándose de operaciones que durante el periodo de ejercicio exista un monitoreo de los precios barrera (campo 70 y 71) tipo Bermuda, es decir, existan un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas de monitoreo de los precios barrera, se deberá anotar la fecha de vencimiento de dicho periodo, con formato AAAA/MM/DD. En caso de operaciones con más de un periodo de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar el complemento de la Sección IX indicando los periodos de monitoreo de los precios barrera para cada periodo de ejercicio correspondiente. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

El valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 70 a 75.

76. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR DOS

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un segundo precio o tasa superior, a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o paga o no, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y con decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos” (a que se refiere el campo 66). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y con decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y con decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa superior, se debe registrar “0” (cero).

En caso que el valor del campo 64 sea distinto a cero, el valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 64 a 68. Asimismo, si el valor del campo 64 es igual a cero, entonces el valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 59 a 63.

77. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR DOS

Tratándose de opciones del tipo “binaria”, “digital”, de “barrera” o “toque”, cuyo contrato establezca un segundo precio o tasa inferior, debajo de la cual la operación se “activa”, “desactiva” o “paga”, en este campo se debe anotar dicho precio o tasa.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y con decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos (a que se refiere el campo 66). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y con decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y con decimales.

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa inferior, se debe registrar “0” (cero).

En caso que el valor del campo 64 sea distinto a cero, el valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 64 a 68. Asimismo, si el valor del campo 64 es igual a cero, entonces el valor de este campo estará relacionado conjuntamente con los campos 59 a 63.

78. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA DOS

En el caso de opciones que se activen o desactiven si el precio de mercado o el nivel del subyacente toca o pasa el (los) precio(s) barrera se deberá anotar la clave conforme al “Catálogo Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO.

Este campo está ligado a los campos 76 y 77.

Por ejemplo, en caso que el valor del campo 76 y 77 sea mayor a cero y que el valor de este campo sea igual a la clave “UI”, “DI”, “UIP” o “DIP”, se entenderá que la opción se “activa” o “paga” en caso que el precio de mercado del subyacente se encuentre dentro de los precios barrera reportados en el campo 76 y 77 respectivamente.

Por otro lado, en caso que el valor del campo 76 y 77 sea mayor a cero y que el valor de este campo sea igual a la clave “UO”, “DO”, “UOP” o “DOP”, se entenderá que la opción se “desactiva” o “no paga” en caso que el precio de mercado del subyacente se encuentre dentro de los precios barrera reportados en el campo 76 y 77 respectivamente.

Asimismo, si la clave reportada en este campo se refiere a una modalidad “Out” y el valor del campo “83. Callable” es distinto de “N”, se entenderá que el precio barrera reportado, ya sea en el campo 76 y/o 77, será la referencia para la terminación anticipada de la totalidad del contrato.

79. INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA DOS

En el caso de operaciones en dónde el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” de forma continua (estilo americano) o en fechas específicas (estilo europeo) para determinar si las barreras se activan o desactivan se deberá anotar la frecuencia con la que se monitorea el precio del subyacente respectivo, expresado en número de días naturales. Por ejemplo, si la frecuencia de monitoreo de las barreras es diaria o trimestral, entonces en este campo deberá registrarse “1” (uno) o “90” (noventa) respectivamente.

Por otro lado, si la frecuencia de monitoreo del o de los precios barrera es continua, entonces en este campo deberá registrarse 0 (cero).

Asimismo, en el caso en que el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” de estilo “Bermuda”, es decir, existan un conjunto de periodos de fechas pre-establecidos y no continuos de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar la frecuencia con la que comienza cada intervalo de monitoreo.

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de operaciones sin barreras, es decir, que el campo 78 haya sido reportado con clave “N”, entonces se debe anotar “0” (cero). Asimismo, este campo está ligado a los campos 76, 77 y 78.

80. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS

Tratándose de operaciones que durante el periodo de ejercicio exista un segundo monitoreo de los precios barrera reportados en el campo 70 y 71, o exista un monitoreo de los precios barrera reportados en el campo 76 y 77, tipo Bermuda, es decir, que existan un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas de monitoreo de los precios barrera, se deberá anotar la fecha de inicio de dicho periodo, con formato AAAA/MM/DD. En caso de operaciones con más de un periodo de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar el complemento de la Sección IX indicando los periodos de monitoreo de los precios barrera para cada periodo de ejercicio correspondiente. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

81. FECHA DE VENCIMIENTO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS

Tratándose de operaciones que durante el periodo de ejercicio exista un segundo monitoreo de los precios barrera reportados en el campo 70 y 71, o exista un monitoreo de los precios barrera reportados en el campo 76 y 77, tipo Bermuda, es decir, que existan un conjunto de fechas pre-establecidas y no continuas de monitoreo de los precios barrera, se deberá anotar la fecha de vencimiento de dicho periodo, con formato AAAA/MM/DD. En caso de operaciones con más de un periodo de monitoreo de los precios barrera, se deberá reportar el complemento de la Sección IX indicando los periodos de monitoreo de los precios barrera para cada periodo de ejercicio correspondiente. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

82. REBATE

En el caso de operaciones en donde exista un pago final o de “compensación” en caso de terminación anticipada de la opción, éste deberá anotarse como porcentaje del importe base o de referencia (campo 15) en la misma moneda del importe base o de referencia (campo 16), con enteros y decimales. Por ejemplo, si el rebate contractual es de 10 por ciento sobre el importe base o de referencia, entonces este campo debe ser igual a 10.

En caso que el rebate este expresado en una moneda diferente a la del importe base o de referencia, el valor del rebate deberá valorizarse a la moneda del importe base o de referencia (campo 16) y expresarse como porcentaje del mismo.

Tratándose de operaciones en donde el pago final o de “compensación” varíe durante la vida de la operación, se deberá reportar el porcentaje del importe base o de referencia (campo 15) en la misma moneda del importe base o de referencia (campo 16), con enteros y decimales en el Complemento de la Sección IX.

Asimismo, si el contrato no contempla un pago final o de “compensación”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

83. CALLABLE

Se deberá anotar:

Uso Público

Información de acceso público.

- | | |
|-----------|---|
| SA | Si existe una condición automática para la barrera “Callable”, es decir, que al momento de que el precio de mercado o el nivel del subyacente toca o pasa la o las barreras estipuladas el conjunto de productos derivados asociados al paquete son terminados anticipadamente. |
| SS | Si existe una condición subjetiva “Callable”, es decir, que el conjunto de productos derivados asociados al paquete son terminados anticipadamente por petición de cualquiera de las partes involucradas. |
| N | Si no existe una condición ya sea automática o subjetiva tipo “Callable”. |

84. REVISIÓN DE LOS “PARAMETROS PRINCIPALES”

Se deberá anotar:

- | | |
|----------|--|
| S | Si durante la vigencia del contrato, al menos uno de los “parámetros principales” es sujeto a revisión (en este caso, debe enviarse el calendario completo de los posibles ejercicios en el Complemento de la Sección IX). |
| N | Si durante la vigencia del contrato ninguno de los “parámetros principales” es sujeto a revisión (Aplica también para operaciones con un solo ejercicio). |

85. 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).

86. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

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 87, 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).

87. CÁMARA DE COMPENSACIÓN

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

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

88. REPOSITORIO DE DERIVADOS

En su caso, se deberá anotar la clave asignada al “Repositorio de Derivados” por medio de la cual se registrará 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 se registrarán en algún Repositorio de Derivados, en este campo se deberá anotar la clave “90” (equivalente a no aplica).

89. 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”.

90. 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.

91. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” de la opción, explicado como el cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en el precio del subyacente en términos monetarios y en la moneda del subyacente informado en el campo “Tipo de Subyacente” (campo 49), en la fecha de concertación correspondiente (campo 5).

92. VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA

Se deberá anotar el valor de volatilidad implícita del activo subyacente (en términos porcentuales y en unidades) utilizada para obtener el precio de mercado de la opción (campo 42), calculada en la fecha de concertación que corresponda (campo 5).

93. IDENTIFICACIÓN DEL CONTRATO ANFITRIÓN

En el caso de operaciones que se encuentran incrustadas en un título de deuda “anfitrión” deberá anotarse la clave Indeval que corresponda a dicho título. En caso que la operación no se encuentre incrustado en un título de deuda “anfitrión”, este campo deberá reportarse vacío.

94. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN UTILIZADO POR LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar un número ya sea secuencial o el folio (alfanumérico) que la institución utilice internamente para identificar la operación. Este campo podrá ser modificado en caso que la institución realice modificaciones a la operación e internamente se le asigne otro número de identificación distinto, por lo que el campo “95. Número de identificación de la operación”, no deberá ser modificado bajo ninguna circunstancia.

Uso Público

Información de acceso público.

95. 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).

96. 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.

Complemento de la Sección IX.- Complemento de operaciones de opción con estructuras exóticas, así como las operaciones de opción en “operaciones estructuradas” o “paquetes de derivados”, celebradas en mercados no reconocidos.

Este complemento debe enviarse para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato, en los que al menos uno de sus “parámetros principales” se modifique en algún momento de su vigencia. De ser el caso, deberá enviarse el detalle de todos y cada uno de los posibles periodos de ejercicio que comprendan dicho paquete. Los diversos campos del registro de cada operación deberán llenarse conforme a lo siguiente:

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Se deberá anotar la misma clave de institución que la reportada en el campo “1” de la Sección IX para la operación correspondiente.

2. FECHA DE CONCERTACIÓN

Se deberá anotar la misma fecha de concertación que la reportada en el campo “5” de la Sección IX para la operación correspondiente.

3. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el mismo número de identificación que el reportado en el campo “95. Número de identificación de la operación” de la Sección IX para la operación correspondiente.

4. NÚMERO DEL PERIODO DE EJERCICIO

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, al menos uno de sus “parámetros principales” estará sujeto a revisión;

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

en este campo se deberá anotar el número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identifica cada uno de los posibles periodos de ejercicio de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros (periodos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 2) y número de identificación (campo 3).

5. IMPORTE BASE APLICABLE AL PERIODO DE EJERCICIO

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, el “importe base” aplicable a los posibles periodos de ejercicio estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en miles de unidades, con decimales, de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el periodo de que se trate, este campo debe reportarse con “0” (cero).

6. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO (INDIVIDUAL) DE EJERCICIO

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada periodo de ejercicio de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

7. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO (INDIVIDUAL) DE EJERCICIO

Se deberá anotar la fecha de término de cada periodo de ejercicio de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

8. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR LA OPERACIÓN

Se deberá reportar el número de días hábiles, posteriores a la fecha de cada periodo de ejercicio para liquidar la operación de que se trate.

9. FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el factor aplicado a la forma de liquidación estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el factor aplicado a la forma de liquidación que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y hasta seis decimales conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión entonces debe reportarse con “0” (cero).

10. DIFERENCIAL APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el diferencial aplicado a la forma de liquidación estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, en su caso, el diferencial con enteros y hasta seis decimales que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y hasta seis decimales conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión entonces debe reportarse con “0” (cero).

11. MEMORIA DEL PAGO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que la memoria del pago estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, si el pago tiene memoria para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes conforme a lo siguiente:

S Cuando el pago tiene memoria durante en el periodo de ejercicio.

N No aplica.

En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, este campo deberá reportarse vacío.

12. TIPO DE SUBYACENTE

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, el tipo de subyacente estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el subyacente (conforme al Anexo F) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes. En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, este campo deberá reportarse vacío.

13. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, la clave del subyacente estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la “clave” (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes.

En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, en este campo se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

14. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión entonces debe reportarse con “0” (cero).

15. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR

Tratándose de opciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa superior (a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo

Uso Público

Información de acceso público.

se deberá anotar, el precio o tasa superior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

16. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR

Tratándose de opciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa inferior (por debajo del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa inferior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

17. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA.

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, la clave de modalidad del precio barrera estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la “clave” (conforme al Anexo AO) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes.

En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, en este campo se deberá anotar la clave “N” (No aplica).

Este campo está ligado a los campos 15 y 16.

18. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada periodo de monitoreo del precio barrera de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

19. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada periodo de monitoreo del precio barrera de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. En caso de que no exista un periodo o monitoreo tipo bermuda de los precios de las barreras, este campo deberá reportarse vacío.

20. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO DOS

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el precio o tasa de ejercicio dos estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión entonces debe reportarse con “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

21. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR DOS

Tratándose de opciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa superior dos (a partir del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa superior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

22. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR DOS

Tratándose de opciones cuyo contrato establezca que el precio o tasa inferior dos (por debajo del cual la operación se “activa”, “desactiva” o se ejerce) estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el precio o tasa inferior que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes (expresado en unidades, con enteros y con decimales, de la moneda en que dicho precio o tasa está expresado, conforme al contrato correspondiente). En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse con “0” (cero).

23. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA DOS

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que durante su vigencia, la clave de modalidad del precio barrera dos estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la “clave” (conforme al Anexo AO) que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes.

En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, en este campo se deberá anotar la clave “N” (No aplica).

Este campo está ligado a los campos 21 y 22.

24. FECHA DE INICIO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada periodo de monitoreo del precio barrera de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. En caso de que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse vacío.

25. FECHA DE TÉRMINO DEL PERÍODO DE LA VENTANA DE LA BARRERA DOS

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada periodo de monitoreo del precio barrera de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. En caso de que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a revisión, entonces debe reportarse vacío.

26. REBATE

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el pago final o de "compensación" en caso de terminación anticipada de la opción estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, el pago final o de "compensación" que aplicará para cada uno de los periodos de ejercicio correspondientes expresado como porcentaje del

Uso Público

Información de acceso público.

importe base o de referencia (campo 15 de la Sección IX o del campo 5 de esta Sección) en la misma moneda del importe base o de referencia (campo 16 de la Sección IX).

En caso que el rebate este expresado en una moneda diferente a la del importe base o de referencia, este valor deberá valorizarse a la moneda del importe base o de referencia y expresarse como porcentaje del mismo.

27. CALLABLE

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que la barrera “Callable” estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar si existe o no terminación temprana del contrato que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes.

SA Si existe una condición automática para la barrera “Callable”, es decir, que al momento de que el precio de mercado o el nivel del subyacente toca o pasa la o las barreras estipuladas el conjunto de productos derivados asociados al paquete son terminados anticipadamente.

SS Si existe una condición subjetiva “Callable”, es decir, que el conjunto de productos derivados asociados al paquete son terminados anticipadamente por petición de cualquiera de las partes involucradas.

N Si no existe una condición ya sea automática o subjetiva tipo “Callable”.

28. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato se establezca el intercambio de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap, se deberá anotar la fecha de inicio del flujo a recibir y/o a entregar de la operación correspondiente a cada periodo, con formato AAAA/MM/DD.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

29. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR O ENTREGAR

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato se establezca el intercambio de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap, se deberá anotar la fecha de vencimiento del flujo a recibir y/o a entregar de la operación correspondiente a cada periodo, con formato AAAA/MM/DD.

Uso Público

Información de acceso público.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

30. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato se establezca el intercambio de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap, y cuyo factor aplicable a la tasa de referencia a recibir o entregar estarán sujetos a revisión, para cada periodo (campos 28 y 29) se deberá anotar el factor de apalancamiento que aplicará para cada uno los periodos con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso que la tasa variable sea igual al 75% de la TIIE a 28 días, en este campo se anotará “.75”

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

31. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR O ENTREGAR

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato se establezca el intercambio de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap, y cuyos puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir o entregar estarán sujetos a revisión, si para cada periodo (campos 28 y 29) se requiere sumar o restar puntos porcentuales, se deberá anotar el signo menos “-” en caso de restar, seguido los puntos porcentuales a sumar o a restar, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso que la tasa variable resulte de sumar 0.35% a la LIBOR-USD a 90 días, en este campo se anotará: “0.35”. Asimismo, en caso que la tasa variable resulte de restar 0.35% a la LIBOR-USD a 90 días, en este campo se anotará: “-0.35”

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

32. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR O ENTREGAR

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato se establezca el intercambio de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar) de un contrato swap, y cuyo valor de la tasa fija a recibir o entregar estará sujeto a revisión, se deberá anotar dicha tasa anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 4.375%, se anotará: 4.375.

Asimismo, si el contrato no contempla intercambios de una serie de flujos referenciados a tasas de interés sobre el importe nominal, similar a una parte (a recibir o a entregar), este campo deberá ser vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

33. 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.

34. IMPORTE DE LA PRIMA

Para cada registro informado en la Sección IX, relativa a la información sobre las opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato cuyo contrato establezca que el importe de la prima estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el importe de la prima que aplicará para cada uno los periodos de ejercicio correspondientes, en miles (con decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato.

35. 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 IX del formulario OPTO.

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.

Secciones X.- Información sobre la “Convalidación” de las opciones vigentes a la fecha de corte, de operaciones que fueron previamente reportadas en la Sección IX

1. CLAVE DE LA INSTITUCIÓN

Este campo se refiere al número asignado para estos efectos por Banco de México a la Institución, o, en su caso, a la filial financiera del exterior de que se trate.

2. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo se refiere a la fecha de concertación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3).

3. FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la operación vigente a confirmar.

4. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 3).

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. POSICIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

A Cuando la operación a la fecha de corte esté registrada de naturaleza acreedora.

D Cuando la operación a la fecha de corte esté registrada de naturaleza deudora.

8. VALOR DE LA VOLATILIDAD IMPLÍCITA

Se deberá anotar el valor de la volatilidad implícita del subyacente (en términos porcentuales y en unidades) en el precio de mercado de la opción vigente de que se trate y en donde aplique la volatilidad tipo “forward”, calculada en la fecha de corte que corresponda (campo 3).

En el caso de reportar el valor de volatilidad tipo “spot” este valor deberá corresponder al siguiente periodo de ejercicio posterior a la fecha de corte que corresponda.

Asimismo, el valor de este campo podrá ser vacío en caso de que se reporte la curva o superficie de volatilidad en la Sección XII referente a “Sensibilidades”, por lo que el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno de los campos 21 a 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

9. VALOR DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar el valor del parámetro “delta” de la opción, explicado como el cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en el precio del subyacente, en miles y con ocho decimales, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3).

En caso de opciones sobre tasas de interés, cuyo valor del parámetro “delta” difiera en cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor del campo 21 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Para las opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá anotar el valor del parámetro “delta” correspondiente al subyacente más representativo de la operación. No obstante, si se informa el valor delta para cada subyacente de la canasta en la Sección XII referente a “Sensibilidades”, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá

Uso Público

Información de acceso público.

ser igual a “S” y el valor del campo 21 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

10. MONEDA DEL PARÁMETRO DELTA

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el valor del parámetro delta (campo 9) conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el valor del campo 9 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado como vacío.

11. VALOR DEL PARÁMETRO GAMMA

Se deberá anotar el valor del parámetro “gamma”, explicado como el cambio en el valor delta con respecto al cambio en el precio del subyacente, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3). El valor de este campo deberá reportarse en miles y con ocho decimales en la moneda en que esté expresada el valor del campo 9.

En caso de opciones sobre tasas de interés, cuyo valor del parámetro “gamma” difiera en cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor del campo 22 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Para las opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá anotar el valor del parámetro “gamma” correspondiente al subyacente más representativo de la operación, por lo que deberá estar asociado al “Valor del parámetro delta” (Campo 9). No obstante, también se podrá anotar dicho valor para cada subyacente de la canasta en la Sección XII referente a “Sensibilidades”, para lo cual el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 17 deberá ser igual a “S” y el valor del campo 22 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

12. VALOR DEL PARÁMETRO VEGA

Se deberá anotar el valor del parámetro “vega”, explicado como el cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en la volatilidad del activo subyacente, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3). El valor de este campo deberá reportarse en miles y con ocho decimales en la moneda en que esté expresada el valor del campo 9.

En caso de opciones sobre tasas de interés, cuyo valor del parámetro “vega” difiera en cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor del campo 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Para las opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá anotar el valor del parámetro “vega” correspondiente al subyacente más representativo de la operación. No obstante, también se podrá anotar dicho valor para cada subyacente de la canasta en la Sección XII referente a “Sensibilidades”, para lo cual el valor de este campo deberá ser igual vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno del campo 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

13. VALOR DEL PARÁMETRO RHO

Se deberá anotar el valor del parámetro “rho”, explicado como el cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en la tasa de interés, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3). Tratándose de operaciones con subyacente tipo de cambio, el valor de este campo deberá corresponder a la tasa de interés que toma el rol de tasa “doméstica”.

En caso que el valor del parámetro Rho Dos difiera de cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno de los campos 21 a 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Para las opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá anotar el valor del parámetro Rho correspondiente al subyacente más representativo de la operación. No obstante, también se podrá anotar dicho valor para cada subyacente de la canasta en la Sección XII referente a “Sensibilidades”, para lo cual el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno de los campos 21 a 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

14. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA RHO DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave de la tasa de referencia con respecto de la cual se calculó el valor del parámetro Rho (campo 13). La clave de la tasa de referencia deberá asignarse conforme el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o conforme al “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT.

Tratándose de operaciones con subyacente tipo de cambio, el valor de este campo deberá corresponder a la tasa de referencia que toma el rol de tasa “doméstica”.

15. VALOR DEL PARÁMETRO RHO DOS

En su caso, se deberá anotar el valor del cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en la tasa de referencia indicada en el campo 16, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3). Tratándose de operaciones con subyacente tipo de cambio, el valor de este campo deberá corresponder a la tasa de interés que toma el rol de tasa “extranjera”. En el caso de acciones, el valor de este campo podrá corresponder a la tasa de dividendos.

En caso que el valor del parámetro “Rho Dos” difiera de cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno de los campos 21 a 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

Asimismo, tratándose de operaciones con subyacente distinto a tipo de cambio, el valor de este campo podrá ser igual a cero “0”.

16. TASA DE REFERENCIA EMPLEADA PARA DETERMINAR UNA SEGUNDA SENSIBILIDAD

Tratándose de operaciones que por sus características dependen de más de una tasa de referencia, en este campo deberá reportarse la segunda tasa de referencia más

Uso Público

Información de acceso público.

representativa, considerando como primera la reportada en el campo 14, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o conforme al “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT. Tratándose de operaciones con subyacente tipo de cambio, el valor de este campo deberá corresponder a la tasa de interés que toma el rol de tasa “extranjera”. En el caso de acciones, el valor de este campo corresponderá a la tasa de dividendos.

Tratándose de operaciones para las cuales no calculen una sensibilidad que no dependen de más de una tasa de referencia, se deberá anotar la clave “NA” (equivalente a no aplica).

17. VALOR DEL PARÁMETRO RHO TRES

En su caso, se deberá anotar el valor del cambio en el precio de la opción con respecto al cambio en la tasa de referencia indicada en el campo 18, calculado en la fecha de corte que corresponda (campo 3). El valor de este campo deberá corresponder a la tasa de interés que toma el rol de tasa utilizada para el colateral de la operación.

En caso que el valor del parámetro “Rho Tres” difiera de cada nodo de la curva, el valor de este campo deberá ser igual a vacío, el valor del campo 20 deberá ser igual a “S” y el valor de alguno de los campos 21 a 23 (“Curva o superficie de referencia de sensibilidad”) deberá ser distinto de vacío.

18. TASA DE REFERENCIA EMPLEADA PARA DETERMINAR UNA TERCERA SENSIBILIDAD

Tratándose de operaciones que por sus características dependen de más de una tasa de referencia, en este campo deberá reportarse la tercer tasa de referencia más representativa, considerando como primera la reportada en el campo 14, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o conforme al “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT. Tratándose de operaciones con subyacente tipo de cambio, el valor de este campo deberá corresponder a la tasa de interés que toma el rol de tasa “extranjera”. En el caso de acciones, el valor de este campo corresponderá a la tasa de dividendos.

Tratándose de operaciones para las cuales no calculen una sensibilidad que no dependen de más de una tasa de referencia, se deberá anotar la clave “NA” (equivalente a no aplica).

19. PRECIO DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar el precio del subyacente en unidades (con enteros y con decimales) utilizado para el cálculo de las sensibilidades reportadas en la fecha de corte (campo 3).

20. COMPLEMENTO DE CURVAS DE SENSIBILIDAD

Se deberá anotar:

- | | |
|----------|--|
| S | Si el valor de las sensibilidades será reportado en la sección XII, relativa a la información sobre Curvas de Sensibilidad y factores de riesgo. |
| N | Si el valor de las griegas o sensibilidad son reportados en esta sección. |

21. CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

En caso de que el campo 20 haya sido reportado con clave “S”, se podrá anotar el identificador alfanumérico que la institución utilice internamente para el nombre de la curva relacionada con el valor del parámetro delta (campo 9). Para las opciones sobre canastas de subyacentes, el valor de este campo podrá ser igual a vacío.

El valor de los identificadores de las curvas de referencia deberá reportarse previamente en el campo 7 de alguno de los registros de la Sección XII.

Asimismo, en caso de que el campo 20 haya sido reportado con clave “N”, el valor de este campo deberá reportarse vacío.

22. CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD DOS

En caso que el campo 20 haya sido reportado con clave “S”, se podrá anotar el identificador (alfanumérico) que la institución utilice internamente para el nombre de la segunda curva relacionada con el valor del parámetro gamma (campo 11). El valor de los identificadores de las curvas de referencia deberá reportarse previamente en el campo 7 de alguno de los registros de la Sección XII. Para las opciones sobre canastas de subyacentes, el valor de este campo podrá ser igual a vacío.

Asimismo, en caso de que el campo 20 haya sido reportado con clave “N”, o no exista una segunda curva o superficie de sensibilidad, el valor de este campo deberá reportarse vacío.

23. CURVA O SUPERFICIE DE REFERENCIA DE SENSIBILIDAD TRES

En caso que el campo 20 haya sido reportado con clave “S”, se podrá anotar el número o el identificador (alfanumérico) que la institución utilice internamente para el nombre de la tercer curva relacionada con el valor del parámetro vega (campo 12). El valor de este campo deberá ser igual al valor reportado en el campo 7 de la Sección XII. Para las opciones sobre canastas de subyacentes, el valor de este campo podrá ser igual a vacío.

En caso que el campo 20 haya sido reportado con clave “N”, o no exista una tercer curva o superficie de sensibilidad, el valor de este campo deberá reportarse vacío.

24. LA OPERACIÓN ES PARTE DE UN “PAQUETE”

En caso que la operación individual (cuyo subyacente sea una tasa de interés) se pueda considerar como parte de un mismo “paquete”, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito (C.U.B.), o en el Artículo 151 de las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Casas de Bolsa (C.U.C.B.), ambas emitidas por la CNBV, se deberá anotar un “1” en este campo.

Sí la operación no es considerada como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B., se deberá anotar “0” (cero).

25. CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B., o en el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 21), se deberá anotar una clave o folio que sirva

Uso Público

Información de acceso público.

para identificar a todas y cada una de las operaciones que formen parte del mismo “paquete”. Por lo anterior, cada grupo de operaciones relativas a una determinado “paquete” deberá tener la misma clave o folio.

Tratándose de operaciones que no se consideren como parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B (“0” en el campo 8), en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

26. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “PAQUETE”

Tratándose de operaciones sobre tasas de interés que, conforme a lo señalado en el Artículo 2 Bis 100 de la C.U.B., o en el Artículo 151 de la C.U.C.B., puedan considerarse como parte de un mismo “paquete” (clave “1” en el campo 21), 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 asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma clave de institución (campo 1), fecha de concertación (campo 2) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 22).

En caso que el campo 25 haya sido reportado con clave “NA”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

27. IMPORTE ACTUALIZADO (MERCADO) DE LA PRIMA (TOTAL)

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos redondeado con decimales) de la operación vigente a la fecha de corte (campo 3) que corresponda. Dicho valor razonable (valor actualizado de la prima) debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la C.N.B.V.

28. CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR LOS ACTIVOS QUE CONSTITUYEN LA GARANTÍA DE LA OPERACIÓN

En caso que el contrato relativo a la opción 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 al formulario OPTO.

Tratándose de operaciones cuyo contrato no contemple el otorgamiento de garantías, este campo deberá ser igual a “SG” (Sin Garantía).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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 IX del formulario OPTO.

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

Secciones XI.- Información sobre las “Canastas” subyacentes en opciones celebradas en mercados no reconocidos

1. CLAVE DE LA CANASTA

Este campo corresponde a la clave asignada por Banco de México a la canasta utilizada como subyacente del contrato derivado incluida 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. En caso que se reporte una nueva canasta (que no exista en el Anexo AF) este campo debe enviarse vacío. Por su parte, cuando cambie alguna característica de una canasta ya registrada en el Anexo AF, este campo debe tener la clave correspondiente a la canasta que se desea modificar.

2. 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.

3. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), INDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

Se deberá indicar la clave ISIN (International Securities Identification Numbering System) 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 correspondiente al subyacente que forma parte de la canasta.

4. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR AL SUBYACENTE QUE FORMA PARTE DE LA CANASTA

Se deberá anotar un número secuencial, consecutivo entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán los subyacentes individuales que formen parte de la canasta. Cada grupo de operaciones relativas a una determinada canasta de subyacentes, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1). Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más operaciones individuales que tengan la misma clave de la canasta asignada por Banco de México (campo 1) y clave de la institución (campo 2).

5. TIPO DE MONITOREO

Se deberá anotar la clave que corresponda al acuerdo a lo siguiente:

WO Si de la canasta se considera el o los subyacentes con el peor rendimiento.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

BE	Si de la canasta se considera el o los subyacentes con el mejor rendimiento.
TO	Si se considera el precio de cada subyacente que compone la canasta.

6. PONDERADOR

Se deberá anotar el porcentaje de participación que tiene el subyacente dentro de la canasta.

7. PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Tratándose de canastas subyacentes cuyo contrato establezca el precio o tasa de ejercicio de cada subyacente que compone dicha canasta, en este campo se deberá anotar el precio por unidad de subyacente o tasa de ejercicio pactado(a) del subyacente de que se trate.

Asimismo, en caso de canastas de subyacentes cuyo contrato que el precio o tasa de ejercicio se refiere al valor total de la canasta, dicho valor se deberá reportar en el campo “57. Precio unitario o tasa de ejercicio” o campo “62. Precio unitario o tasa de ejercicio dos” (según corresponda) de la Sección IX y el valor de este campo deberá ser igual a “0” (cero).

8. FORMA EN LA QUE ESTÁ REPRESENTADO EL PRECIO DE EJERCICIO.

Se deberá anotar la clave de la forma en que está expresado el precio de ejercicio reportado en el campo 7, de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Tipo de precio” a que se refiere el Anexo AM. Por ejemplo, en caso de operaciones sobre índices se deberá reportar la clave “4” referente a puntos.

9. MONEDA DEL PRECIO UNITARIO O TASA DE EJERCICIO

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio o tasa de ejercicio (campo 7) conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

10. PRECIO INICIAL DEL SUBYACENTE

Se deberá anotar el precio inicial del subyacente en unidades (con enteros y con decimales) de acuerdo a la proveedora de precios y hora establecida en el contrato. En caso que el precio de ejercicio (campo 7) se encuentre expresando en términos porcentuales (clave “3” del campo 8), entonces el valor de este campo será utilizado para calcular el valor nominal de dicho precio de ejercicio.

11. CÁLCULO APLICABLE AL PRECIO DEL SUBYACENTE PARA DETERMINAR EL EJERCICIO DE LA OPCIÓN

Se deberá anotar la clave del cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de las opciones de acuerdo al contrato, conforme al “Catálogo Cálculo de Ejercicio” a que se refiere el Anexo AN. Por ejemplo, tratándose de operaciones tipo “Asiática”, el valor de este campo deberá ser igual a la clave “4”.

12. CÁLCULO DE LIQUIDACION

Se deberá anotar la clave que corresponda al cálculo de liquidación, conforme al “Catálogo de Cálculo de liquidación” a que se refiere el Anexo AK. La clave seleccionada se utilizará conjuntamente con el campo “13. Factor aplicado a la liquidación” y el campo “7. Precio unitario o de ejercicio”.

Uso Público

Información de acceso público.

13. FACTOR APLICADO A LA FORMA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá anotar, en su caso, el factor con enteros y decimales que deberá multiplicar al resultado del Cálculo de Liquidación (campo 12).

Tratándose de operaciones que no contemplen un factor este campo deberá ser igual a “100” (cien).

14. PRECIO DE LA BARRERA SUPERIOR

Se deberá anotar el precio o tasa superior, a partir del cual el subyacente se “activa” o “desactiva” dentro de la canasta de subyacentes.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 7). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa superior para el subyacente de la canasta, se debe registrar “0” (cero).

15. PRECIO DE LA BARRERA INFERIOR

Se deberá anotar el precio o tasa inferior, a partir del cual el subyacente se “activa” o “desactiva” dentro de la canasta de subyacentes.

Tratándose de precio unitario, éste se deberá anotar en unidades (con enteros y decimales) de la “Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (a que se refiere el campo 7). Tratándose de tasas de interés, éstas se deberán anotar en porcentaje y en términos anuales, con enteros y decimales. De forma similar, para aquellas operaciones donde el precio de ejercicio se encuentre en términos porcentuales, el precio de esta barrera deberá anotarse en porcentaje y decimales.

En el caso de operaciones cuyo contrato no contemple un precio o tasa inferior para el subyacente de la canasta, se debe registrar “0” (cero).

16. MODALIDAD DEL PRECIO BARRERA

En el caso de opciones cuyo activo de la canasta de subyacentes se active o desactive si el precio de mercado o el nivel del subyacente toca o pasa el (los) precio(s) barrera se deberá anotar la clave conforme al “Catálogo Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO.

Este campo está ligado a los campos 14 y 15.

17. INTERVALO O FRECUENCIA DE MONITOREO DEL O LOS PRECIOS BARRERA

En el caso de operaciones en dónde el precio de mercado del subyacente es “monitoreado” para determinar si las barreras se activan o desactivan se deberá anotar la frecuencia con la que se monitorea el precio del subyacente respectivo, expresado en número de días

Uso Público

Información de acceso público.

naturales. Por ejemplo, si la frecuencia de monitoreo de las barreras es diaria o trimestral, entonces en este campo deberá registrarse “1” (uno) o “90” (noventa) respectivamente.

En el caso de operaciones sin barreras, es decir, que el campo 16 haya sido reportado con clave “N”, entonces se debe anotar “0” (cero).

Por otro lado, si la frecuencia de monitoreo del o de los precios barrera es continua, entonces en este campo deberá registrarse 0 (cero).

Asimismo, este campo está asociado a los campos 14, 15 y 16.

Secciones XII.- Información sobre Curvas de Sensibilidad y factores de riesgo en opciones celebradas en mercados no reconocidos

En caso de que la información sobre el factor de riesgo a reportar en esta sección (campo 6) corresponda a una operación de opción en específico (campo 4 distinto de vacío), deberá coincidir con un registro reportado en la Sección “X”, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

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. FECHA DE CONCERTACIÓN

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) corresponda a una operación de opción en particular, por ejemplo, a opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá reportar la fecha de concertación de la operación, con formato AAAA/MM/DD, que haya sido reportada previamente en el campo 5 (“Fecha de concertación”) de la Sección IX referente a “Opciones exóticas”, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 5) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 94).

En caso que el factor de riesgo (campo 6) a reportar se refiera a una curva o superficie (clave 6 a 8), el valor de este campo podrá ser igual a vacío.

3. FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponde la información de las curvas de sensibilidades o factores de riesgos en opciones celebradas en mercados no reconocidos.

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

En caso que el factor de riesgo (campo 6) corresponda a una operación de opción en particular, deberá anotarse el número de identificación de dicha operación.

Uso Público

Información de acceso público.

Tratándose de opciones sobre canastas de subyacentes, el valor de este campo deberá el mismo para todos los registros equivalentes al número de subyacentes que conforman la canasta.

5. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR REGISTROS QUE FORMAN PARTE DEL FACTOR DE RIESGO

Se deberá anotar un número secuencial, consecutivo entero, iniciando con el número uno (1), indicando el número de registros que formen parte del mismo factor de riesgo (campo 6). Cada grupo de registros relativos a un determinado factor de riesgo, deberá tener su propia numeración secuencial, iniciando en todos los casos con el número uno (1).

En el caso de opciones sobre canastas de subyacentes, el número de registros reportados corresponderá al número de subyacentes que integran la canasta, por lo que el número de registros reportados de esta sección, para una canasta en particular, deberá ser igual al número de subyacentes reportados previamente en la Sección XI referente a “Canastas de subyacentes”, a que corresponde el número de identificación (campo 2) de acuerdo con la clave de la canasta asignada (campo 1 de la Sección XI) reportada en el campo 50 de la Sección IX en su fecha de concertación.

Adicionalmente, un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros individuales que tengan la misma “Clave de la institución” (campo 1) y misma “Fecha de Corte” (campo 3), mismo “Número de Identificación de la Operación” (campo 4), mismo “Factor de riesgo” (campo 6), misma “Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” (campo 7), misma “Fecha del nodo de la curva” (campo 8), así como mismo “Plazo del nodo de la curva” y “Temporalidad del plazo” (campo 9 y 10 respectivamente).

6. NOMBRE DEL FACTOR DE RIESGO

Se deberá anotar la clave asignada al factor de riesgo, conforme al “Catálogo de Factor de Riesgo” a que se refiere el Anexo AR.

7. CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO

En caso de opciones sobre canastas de subyacentes, se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente 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. El valor reportado en este campo en combinación con su número consecutivo (campo 5) deberá ser igual al valor reportado en el campo 3 en combinación con el campo 4 (ambos de la Sección XI), de acuerdo a la clave de canasta asignada (campo 1 de la Sección XI) reportada en el campo 50 de la Sección IX en su fecha de concertación, utilizando para ello los campos llave, institución, fecha de concertación y número de identificación.

En caso, que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves “6” a “8”), se deberá anotar la “clave” que corresponda a la curva o superficie, conforme al “Catálogo de

Uso Público

Información de acceso público.

Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT. Asimismo, el valor de este campo deberá ser igual al valor reportado en alguno de los campos 21 a 23 de los registros de la Sección X.

8. FECHA DEL NODO DE LA CURVA

En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), se deberá anotar la fecha del nodo que corresponda al valor reportado en el campo 11 y al campo 13, en su caso, de esta Sección.

9. PLAZO DEL NODO DE LA CURVA

En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), se deberá anotar el plazo correspondiente a la fecha del nodo de la curva (campo 6) a que se refiere el valor reportado en el campo 13 y campo 15, en su caso, de esta Sección.

10. TEMPORALIDAD DEL PLAZO

En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), se deberá anotar la temporalidad a que se refiere el plazo reportado en el campo 9, conforme al “Catálogo de Temporalidad del plazo” a que se refiere el Anexo AS. Por ejemplo, en caso que el plazo reportado sea en días, el valor de este campo deberá ser igual a “D”.

11. VALOR DE LA GRIEGA O SENSIBILIDAD

Se deberá anotar el valor de la griega o sensibilidad a que se refiere el campo 6. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), el valor de este campo podrá ser vacío.

12. MONEDA DEL VALOR DE LA GRIEGA O SENSIBILIDAD

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el valor de la griega o sensibilidad (campo 11) conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el valor del campo 11 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

13. VALOR ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO

El valor de este campo podrá ser vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva (clave “6” o “7”), el valor de este campo deberá ser distinto de vacío y deberá corresponder al valor correspondiente a dicho factor de riesgo. Asimismo, en caso de que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una superficie de volatilidad (clave “8”), el valor de este campo deberá ser distinto de vacío y deberá corresponder al precio de ejercicio utilizado como parámetro del valor de volatilidad implícita reportado en el campo 15 (“Valor dos asociado al factor de riesgo”).

El valor de este campo deberá reportarse en unidades (con enteros y con ocho decimales).

14. MONEDA DEL VALOR ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el valor asociado al factor de riesgo (campo 11) conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el valor del campo 13 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

15. VALOR DOS ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO

El valor de este campo podrá ser vacío. En caso de que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una superficie de volatilidad (clave 8), el valor de este campo deberá ser distinto de vacío y deberá corresponder a la volatilidad implícita resultante del parámetro reportado en el valor asociado al factor de riesgo (campo 13), en unidades (con enteros y con decimales).

En caso que no exista un segundo valor asociado al factor de riesgo (campo 6), este campo deberá reportarse vacío.

16. MONEDA DEL VALOR DOS ASOCIADO AL FACTOR DE RIESGO

Se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el valor dos asociado al factor de riesgo (campo 15) conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el valor del campo 15 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

17. PRECIO DEL SUBYACENTE UTILIZADO PARA EL FACTOR DE RIESGO

Se deberá anotar el precio del subyacente en unidades (con enteros y con ocho decimales) utilizado como parámetro del valor asociado al factor de riesgo (campo 13 o 15). Por ejemplo, en caso de una superficie de volatilidad (clave 8 del campo 6), se deberá reportar el precio del subyacente utilizado para determinar el grado del dinero de dicha superficie de volatilidad.

En caso que el precio del subyacente no sea un parámetro asociado al factor de riesgo (campo 13 o 15), el valor de este campo podrá reportarse vacío.

18. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR REGISTROS QUE FORMAN PARTE DEL MISMO ENVÍO

Se deberá anotar un número secuencial, consecutivo entero, iniciando con el número uno (1), indicando el número de registros que formen parte del mismo envío; es decir, cuyos registros tengan la misma la misma “Clave de la institución” (campo 1) y misma “Fecha de Corte” (campo 3). Por lo tanto, un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros individuales que tengan la misma “Clave de la institución” (campo 1) y misma “Fecha de Corte” (campo 3).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario

Sección I.- Opciones Celebradas en Mercados Reconocidos (Bursátiles)

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. Oficina que realiza la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Catálogo A 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” (conforme al “Catálogo de Instituciones con Agencias y/o Sucursales en el Extranjero”, si la institución del campo 1 no aparece en dicho catálogo, entonces este campo no puede ser igual a “A”).

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 (campo 1 inicia con “040”), institución de banca de desarrollo (campo 1 inicia con “037”), una casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o una SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

3. Origen de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe aceptar únicamente las claves “P” o “T”.

4. Clave de la persona cliente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave asignada por Banco de México o en su caso el Código LEI de la “Persona Cliente”, deberán estar vigentes. Además, la clave o código que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

Adicionalmente, si el campo 3 (“Origen de la operación”) es igual a “P”, entonces la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 19 (“Código LEI de la Institución”).

En caso que el campo 3 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo 19. Cuando la persona cliente no tenga un Código LEI se deberá reportar la clave Banxico de seis caracteres.

Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5. 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.

6. 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 8.

Asimismo, esta fecha debe corresponder a un día hábil bancario, ya sea en México o el extranjero.

7. Posición en la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”.

8. Clave de Pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el mercado (campo 5) sea distinto de “MEX”, entonces la clave de “pizarra” que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA.

Si el campo 5 (Mercado) es igual a “MEX”, entonces la clave reportada por las instituciones en este campo debe tener el siguiente formato “XY123456Z”; es decir, un largo máximo de 8 caracteres, de los cuales los dos primeros y el último deben ser letras mayúsculas, mientras que el resto deben ser exclusivamente números. Adicionalmente, el resultado de concatenar dichas dos primeras letras con la última letra, forma una clave nueva que debe estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA. Por ejemplo, si la clave reportada en este campo es “IP45500F”; entonces la clave nueva generada conforme a lo señalado anteriormente, debe ser “IPF”; la cual debe estar comprendida en el Anexo AA.

Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Anexo AA) debe ser idéntico al registrado en el campo 5 (Mercado). Adicionalmente, la columna “clase_der” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “C” o “V” (es decir, Opciones tipo “Call” o tipo “Put”).

9. 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.

10. Número de Contratos

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno. En caso de las operaciones concertadas en Mexder, este campo deberá ser menor o igual al número total de contratos, por pizarra, indicado por Asigna.

11. Precio Unitario o Tasa de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor a 150 mil.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

12. Importe de la Prima (Total)

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

13. Moneda en que está expresada la prima

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el campo 12 (“Importe de la Prima Total”) sea mayor que “0” (cero), este campo debe ser distinto de las claves “0”, “102”, “979” y “990”.

En caso que el campo 12 (“Importe de la Prima Total”) sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

14. Número de Identificación de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 6).

15. Socio liquidador de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la entidad denominada “socio liquidador de la operación” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O.

16. Operador de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Se deberá anotar la clave de la entidad denominada “operador o facilitador de la operación” que esté comprendida en el “Catálogo de Operadores o Facilitadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo P.

17. Cámara de Compensación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de la “cámara de compensación” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cámaras de Compensación” o “Contraparte Central” a que se refiere el Anexo L.

Adicionalmente, la columna “Mercado” del Anexo L, que corresponda a la cámara de compensación, deberá ser idéntico a la clave registrada en el campo 5 (“Mercado”).

18. Valor del Parámetro Delta

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a “1” (uno) y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq x \leq 1$).

19. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Sección II.- Opciones Celebradas en Mercados No Reconocidos.

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. Oficina que realiza la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Anexo A.

Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución tenga “Agencias o Sucursales en el Extranjero” (conforme al “Catálogo de Instituciones con Agencias y/o Sucursales en el Extranjero”, si la institución del campo 1 no aparece en dicho catálogo, entonces este campo no puede ser igual a “A”). 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 que la clave de institución (del campo 1) corresponda a una institución de banca múltiple (campo 1 inicia con “040”), una institución de banca de desarrollo (campo 1 inicia con “037”), una casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o una SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

3. 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 segundo párrafo 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 46.

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

4. Fecha de Concertación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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

5. Fecha de Inicio del Período de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, cuando el campo 10 (“Modalidad de liquidación al ejercicio”) sea igual a “A” o “B”, la fecha registrada debe ser mayor o igual que la “Fecha de concertación” (campo 4). Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

En caso que el campo 10 (“Modalidad de liquidación al ejercicio”) sea igual a “E”, y el campo 21 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a “90”, entonces la fecha registrada en este campo debe ser igual a la “Fecha de concertación” (campo 4).

En caso que el campo 10 (“Modalidad de liquidación al ejercicio”) sea igual a “E”, y el campo 21 (“La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”) sea igual a “1” o “2”, entonces la fecha registrada en este campo puede ser menor, igual o mayor que la “Fecha de concertación” (campo 4).

Si el campo 10 (“Modalidad de liquidación al ejercicio”) es igual a “E”, mientras que el campo 21 (“La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”) es distinto de las claves “1”, “2” o “90”, entonces la fecha registrada debe ser mayor o igual que la “Fecha de concertación” (campo 4).

6. Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor a la “Fecha de inicio del periodo de ejercicio” (campo 5). Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

7. 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).

8. Posición en la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”.

9. Tipo de Opción

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves: “C”, “V” u “O”.

10. Modalidad de liquidación al ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves: “A”, “E” o “B”.

11. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

12. Monto Base o de Referencia

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual o mayor que uno.

Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) cuya clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “24-Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Acción individual”, “Combustible”, “Metales”, “Producto Agrícola”, “Títulos deuda” o “Títulos referenciados”, el valor numérico de este campo deberá ser igual al resultado de multiplicar el valor del campo 30 (“Número de Unidades del Subyacente”) por el campo 32 (“Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”), siempre que este precio este sea mayor que cero, y dividir entre mil.

En caso de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) cuya clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “24-Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a “Canasta Acciones”, “Canasta Índices”, “Derivados”, “Divisas”, “Índices Accionarios”, “Índices sobre inflación” o “Tasas de interés”, este campo debe ser igual o mayor que “1” (uno).

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquéllas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), este campo debe ser igual o mayor que “1” (uno).

13. Moneda del Importe Base o 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.

Debe ser distinta de la clave “O”. En el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquéllas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) con campo 24 (“Tipo de Subyacente”) igual a la clave “TIC” (es decir, el subyacente es un tipo de cambio), entonces la clave de este campo debe ser igual: i) al campo 31 (“Moneda del Subyacente”), o ii) al campo 33 (“Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”).

Adicionalmente, para las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) cuya clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “24-Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Combustible”, “Índices accionarios”, “Metales”, “Producto Agrícola”, “Títulos deuda”, la moneda de este campo debe ser la misma que la moneda del campo “33-Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”; siempre y cuando esta última sea distinta de “O” (cero). En caso de que la clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “24-Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Acción individual” o “Títulos referenciados”, y la moneda de este campo sea diferente a la moneda del campo “33-Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”, siempre y cuando esta última sea distinta de “O” (cero), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Uso Público

Información de acceso público.

Tratándose operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), 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).

14. Forma de Liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y debe aceptar únicamente las claves “S” o “D”.

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), este campo debe ser igual a “D”.

Las siguientes validaciones aplican para opciones distintas a las “binarias” o “digitales”, es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”:

- 1) Tratándose de operaciones en las que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 37) sea igual a: “13”, “17”, “18”, “19”, “20”, “22”, “27”, “50”, o “51”, entonces este campo debe ser igual a “D”.
- 2) En caso que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 37) sea igual a: “23”, “24”, “25” o “26”, y este campo sea igual a “S”, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.
- 3) Asimismo, cuando el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) sea igual a “TIC”, este campo debe ser igual a “D”.
- 4) Cuando en una misma operación, el campo “37-Tipo de Producto Derivado” sea igual a “21” y el campo “24-Tipo de Subyacente” sea distinto de “TIC”, entonces este campo debe ser igual a “S”.
- 5) En caso que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 37) sea igual a: “14”, “15”, “16”, “28” o “49”, este campo puede ser igual a “D” o “S”.

Las siguientes validaciones aplican para opciones distintas a las “binarias” o “digitales”, es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”:

- 1) Sin embargo, si el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 37) es igual a “52” y este campo igual a “S” se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.
- 2) En caso que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 37) sea igual a: “23”, “24”, “25” o “26”, y este campo sea igual a “S”, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

15. Moneda de Liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Debe ser distinta de las claves “0”, “102”, “979” y “990”. Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) en las que el campo “Tipo de Subyacente” (campo 24) sea igual a “TIM” o “TIX”, entonces este campo debe ser igual al campo 13 (“Moneda del Importe Base o Referencia”).

En el caso de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) con campo 24 (“Tipo de Subyacente”) igual a “979” (UDIS mexicanas), o “SMA” (Salario Mínimo Vigente en el D.F.), entonces este campo debe ser igual a “484” (Pesos mexicanos).

Para operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) con campo 24 (“Tipo de Subyacente”) igual a “990” (Unidades de Fomento Chilenas), entonces este campo debe ser igual a “152” (Pesos chilenos).

En el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) con campo 24 (“Tipo de Subyacente”) igual a alguna de las claves de la “32” a la “990”, excepto 979 y 990,” (es decir, el subyacente es una divisa), entonces la clave de este campo debe ser distinta de dicho campo 24 (“Tipo de subyacente”).

Tratándose operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), la clave de este campo debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de la claves “0” (cero), “102”, “979” y “990”.

16. Existencia de tipo de cambio Forward “Quanto”

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S” o “N”.

Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) y cuyo subyacente sea igual a una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby = “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “24-Tipo de Subyacente” sea igual a “Divisas” o “Tasas de interés”), entonces este campo deberá ser igual a “N”.

En caso de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”), cuyo subyacente sea distinto de una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby = “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “24-Tipo de Subyacente” sea diferente de “Divisas” o “Tasas de interés”) y que la “Moneda del Subyacente (campo 31) sea diferente de la “Moneda de Liquidación” (campo 15), entonces este campo debe ser igual a “S”. Si este campo es igual a “N”, cumpliéndose las mismas condiciones anteriores, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la existencia de un tipo de cambio predeterminado o “Quanto”, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Uso Público

Información de acceso público.

Para las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”), cuyo subyacente sea distinto de una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby = “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “24-Tipo de Subyacente” sea diferente de “Divisas” o “Tasas de interés”) y que la “Moneda del Subyacente (campo 31) sea igual a la “Moneda de Liquidación” (campo 15), entonces este campo debe ser igual a “N”.

Para las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”), cuyo subyacente sea a un tipo de cambio (es decir, cuando el campo “24-Tipo de Subyacente” sea igual a “TIC”), y que la “Moneda de Liquidación” (campo 15) sea distinta de: i) la “Moneda del Subyacente” (campo 31), o la “Moneda del Precio” (campo 33); entonces este campo debe ser igual a “S”. En caso que la “Moneda de Liquidación” (campo 15) sea igual a: i) la “Moneda del Subyacente” (campo 31), o la “Moneda del Precio” (campo 33), entonces este campo debe ser igual a “N”. Por ejemplo, si el valor del campo 24 es igual a “756” (Franco Suizo), que de acuerdo a la columna “clase_suby” del Anexo F es igual a “Divisas”, entonces este campo debe ser igual a “N”.

Tratándose de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a “O”) en las que la clave del campo “13- Moneda del Importe Base” sea diferente de la clave del campo “15 Moneda de Liquidación”, entonces este campo debe ser igual a “S”.

En caso que este campo sea igual a “N”, cumpliéndose las mismas condiciones anteriores, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la existencia de un tipo de cambio predeterminado o “Quanto”, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Cuando la clave del campo “13- Moneda del Importe Base” sea igual a la clave del campo “15 Moneda de Liquidación”, entonces este campo debe ser igual a “N”.

17. Tipo de cambio Forward “Quanto”

En caso que el campo 16 (“Existencia de Tipo de Cambio Forward Quanto”) sea igual a “S”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor debe ser mayor que cero.

En caso que el campo 16 (“Existencia de Tipo de Cambio Forward Quanto”) sea igual a “N”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

18. Importe de la Prima (Total)

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

19. Moneda en que está expresada la prima

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

En caso que el campo 18 (“Importe de la Prima Total”) sea mayor que “0” (cero), este campo debe ser distinto de las claves “0”, “102”, “979” y “990”.

Uso Público

Información de acceso público.

En caso que el campo 18 ("Importe de la Prima Total") sea igual a "0" (cero), entonces este campo debe ser igual a "0" (cero).

20. Fecha de pago/cobro de la prima

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 18 ("Importe de la Prima Total") sea mayor que "0" (cero), la fecha de este campo debe ser menor o igual a la fecha que resulte de sumar, la "Fecha de término del periodo de ejercicio" (campo 6) más el "Número de Días Hábiles para Liquidar la Operación" (campo 7), considerando el calendario bancario de días inhábiles bancario (ya sea en México o en el extranjero); y mayor o igual a la "Fecha de concertación" (campo 4).

En caso que el campo 18 ("Importe de la Prima Total") sea igual a "0" (cero), este campo debe reportarse vacío. En caso que el campo 18 ("Importe de la Prima Total") sea distinto a "0" (cero), este campo debe ser mayor o igual a la "Fecha de concertación" (campo 4).

21. 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 "opto2".

Tratándose de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O") que tengan "1" o "2" en este campo, entonces el campo 37 ("Tipo de Producto Derivado") debe ser igual a "13", "51" o "52".

En caso de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O") que tengan "3" o "4" en este campo, entonces el campo 37 ("Tipo de Producto Derivado") debe ser distinto de "13".

Tratándose de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O") que tengan "16" en este campo, entonces el campo 37 ("Tipo de Producto Derivado") debe ser igual a alguna de las claves siguientes: "16", "18", "20" o "52".

Para las operaciones "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea igual a "O"), este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes: "5", "12", "13", "14", "15", "29", "41", "54" o "40".

Para las operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O"), que tengan la clave "SWP" en el campo 24 "Tipo de Subyacente", entonces este campo debe ser igual a la clave "6". Asimismo, si este campo es igual a la clave "6", entonces el campo 24 "Tipo de Subyacente" debe ser igual a la clave "SWP".

Para las operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O"), que tengan la clave "FWD" en el campo 24 "Tipo de Subyacente", entonces este campo debe ser igual a la clave "7". Asimismo, si este campo es igual a la clave "7", entonces el campo 24 "Tipo de Subyacente" debe ser igual a la clave "FWD".

Uso Público

Información de acceso público.

22. 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 21 (“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 21 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA”.

23. 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 21 (“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 22 (“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 4) 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 2).

En caso que el campo 21 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a “90” (y por tanto, el campo 22 sea igual a “NA”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

24. Tipo de subyacente

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.

25. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 24 (“Tipo de Subyacente”) corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a “TIC”), un índice accionario (sea igual a “IAM” o “IAX”), una canasta de índices accionarios (sea igual a “I99”), un título de deuda (sea igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés de referencia (sea igual a “TIM” o “TIX”), un título representativo de capital (sea igual a “ACM” o “ACE”), una canasta de acciones (sea igual a “G01”), o un título referenciado (sea igual a “TRM” o “TRE”), la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

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 “24-Tipo de Subyacente”.

Asimismo, si la clave del campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a alguna de las claves siguientes: “IAM”, “IAX”, “I99”, “TDM”, “TDE”, “TIM”, “TIX”, “ACM”, “ACE”, “G01”, “TRM” o

Uso Público

Información de acceso público.

“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 24 (“Tipo de Subyacente”) es distinta de un tipo de cambio (no es igual a “TIC”), un índice accionario (no es igual a “IAM”, “IAX” o “I99”), un título de deuda (no es igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés variable (no es igual a “TIM” o “TIX”), un título representativo de capital (no es igual a “ACM” o “ACE” “G01”) o un título referenciado (no es igual a “TRM” o “TRE”), este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

26. Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

En caso que este campo sea mayor que “0” (cero), el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 6 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 5 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”). En caso contrario, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el valor del intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En el caso de operaciones con modalidad de liquidación al ejercicio tipo “Bermuda” (campo “10-Modalidad de liquidación al ejercicio” igual a “B”), entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

En el caso de operaciones que formen parte de un “paquete” con múltiples ejercicios posibles (es decir que el campo “21-La operación es parte de una operación estructurada o paquete” sea igual a “1”, “2”, “3”, “4” o “5”), entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

En caso que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces su valor debe ser igual o mayor que el campo 27 (“Intervalo o frecuencia de monitoreo del Precio del Subyacente”).

27. Intervalo o frecuencia de monitoreo del precio del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

En caso que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 6 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 5 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”). En caso contrario, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el valor del intervalo o frecuencia de monitoreo del Precio del Subyacente, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En el caso de operaciones con modalidad de liquidación al ejercicio tipo “Europea” (campo “10-Modalidad de liquidación al ejercicio” igual a “E”), cuyo campo 21 “La operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’” sea distinto de la clave 39 y con ejercicios únicos

Uso Público

Información de acceso público.

(campo "28.- Número Total de Posibles Ejercicios" igual a "1"), entonces este campo debe ser igual a "0" (cero).

En el caso de operaciones que monitorean el precio de mercado del subyacente (es decir, que el campo "21-La operación es parte de una operación estructurada o paquete" sea igual a "1", "2", "3", "4", "5" o "39"), entonces este campo debe ser mayor que "0" (cero).

28. Número total de posibles ejercicios

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando la clave del campo 21 ("La operación es parte de una operación estructurada o paquete") sea igual a alguna de las claves de la "1" a la "5", entonces este campo debe ser mayor o igual que "1" (uno) y menor o igual que 240. En caso que la clave del campo 21 ("La operación es parte de una operación estructurada o paquete") sea igual a alguna de las claves de la "16" a la "19", o "90", entonces este campo debe ser igual a "1" (uno).

Tratándose de registros con clave del campo 21 ("La operación es parte de una operación estructurada o paquete") distintas a las señaladas en los dos párrafos anteriores, entonces este campo debe ser igual o mayor que "1" (uno).

En caso que este campo sea mayor que 1, entonces el resultado de multiplicar este campo por el campo 26 (Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios) debe ser menor o igual al número de días naturales que resulten de restar al campo 6 ("Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio"), el campo 5 ("Fecha de Inicio de Período de Ejercicio"). En caso contrario, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: "Favor de confirmar el Número Total de Posibles Ejercicios, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente".

29. Número de identificación de la operación derivada subyacente

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 24 ("Tipo de Subyacente") sea igual a la clave "FWD" o "SWP", este campo debe tener una clave o folio que sea distinto de "NA".

En caso que el campo 24 ("Tipo de Subyacente") sea distinto de las claves "FWD" o "SWP", este campo debe reportarse vacío.

30. Número de unidades del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O"), cuyo subyacente sea diferente de una divisa, un tipo de cambio, un "forward", un "swap" o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna "Clase del Subyacente" (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo "24-Tipo de Subyacente" sea diferente de "Divisas", "Derivados" o "Tasas de interés"), entonces este campo debe ser mayor o igual que uno.

En caso de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que el campo "9-Tipo de Opción" sea diferente de la clave "O"), cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio, un "forward", un "swap" o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna "Clase del Subyacente" (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente

Uso Público

Información de acceso público.

reportado en “24-Tipo de Subyacente” sea igual a “Divisas”, “Derivados” o “Tasas de interés”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

31. Moneda del subyacente

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

Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”), cuyo subyacente sea una divisa (es decir que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a alguna de las claves “32” a “986”, excepto las claves “979” y “102”) entonces la moneda de este campo debe ser igual a la moneda del campo 13 (“Moneda del Importe Base o de Referencia”) y también debe ser igual a la clave del campo 24 (“Tipo de Subyacente”).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea igual a un índice accionario (es decir, que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a “IAM” o “IAX”), un título de deuda (es decir, que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a “TDM” o “TDE”), un título representativo de capital (es decir, que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a “ACM” o “ACE”), o un título referenciado a acciones (es decir, que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a “TRM” o “TRE”), o una tasa de interés (es decir, cuando el campo “campo 24 - Tipo de Subyacente” es igual a “TIM” o “TIX”), entonces este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda al subyacente registrado en el campo 25 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”), conforme a la columna “mda_suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (es decir, que el “campo 24 - Tipo de Subyacente” sea igual a “TIC”), entonces este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda a la clave del tipo de cambio registrado en el campo 25 (“Clave del Valor, Índice Accionarios, Tasa de Interés o Tipo de Cambio”), conforme a la columna “suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.

Adicionalmente cuando el campo 25 (“Clave del Valor, Índice Accionarios, Tasa de Interés o Tipo de Cambio”) sea igual a “NA” y la clave del campo 24, corresponda a alguna de las siguientes clases de subyacente del catálogo “F” (en el campo “clase_suby”): “Producto Agrícola”, “Combustibles” o “Metales”, entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de la moneda que corresponda, conforme a la columna “mda_suby” del Anexo F.

32. Precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que “0” (cero) y menor que 400 mil.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

En particular, si el campo “21-La operación es parte de una Operación Estructurada o Paquete” es igual a las claves “10” u “11”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Asimismo, si el campo “9-Tipo de Opción” es igual la clave “O”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

33. Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el Precio Unitario o Tasa de Ejercicio (campo 32) sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

En el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”) con campo 24 (“Tipo de Subyacente”) igual a alguna de las claves de la “32” a la “990” (es decir, el subyacente es una divisa), entonces la clave de este campo debe ser distinta al campo 24 (“Tipo de subyacente”).

En caso que el campo 24 (“Tipo de subyacente”) sea igual a “IAM”, “IAX” y que el campo 32 “Precio unitario o tasa de ejercicio” sea distinto de cero entonces la clave de este campo deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de las claves “0”, “102”, “979” y “990” y se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En caso que el campo 25 (“Clave del Valor, Índice Accionarios, Tasa de Interés o Tipo de Cambio”) sea distinto a “NA” y que el campo 24 (“Tipo de subyacente”) sea distinto a “IAM”, “IAX”, “ACE” y que el campo 32 “Precio unitario o tasa de ejercicio” sea distinto de cero, entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda a la clave registrada en el campo 25 (“Clave del Valor, Índice Accionarios, Tasa de Interés o Tipo de Cambio”), conforme a la columna “mda_suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.

Adicionalmente cuando el campo 25 (“Clave del Valor, Índice Accionarios, Tasa de Interés o Tipo de Cambio”) sea igual a “NA”, la clave del campo “24 - Tipo de Subyacente”, corresponda a alguna de las siguientes clases de subyacente del catálogo “F” (en el campo “clase_suby”): “Producto Agrícola”, “Combustibles” o “Metales” y que el campo 32 “Precio unitario o tasa de ejercicio” sea distinto de cero, entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de la moneda que corresponda, conforme a la columna “mda_suby” del Anexo F.

34. Precio de la Barrera Superior

Este campo no podrá reportarse vacío. En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo 36- “Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que si tengan precios barrera (campo 36- “Modalidad del Precio Barrera” igual a “I”, “D” u “O”), entonces este campo debe ser igual o mayor que “0” (cero).

35. Precio de la Barrera Inferior

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío. En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo 36- “Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Tratándose de operaciones que si tengan precios barrera (campo 36- “Modalidad del Precio Barrera” igual a “I”, “D” u “O”), entonces este campo debe ser igual o mayor que “0” (cero).

Adicionalmente, para éstas operaciones, al menos uno de los dos precios barrera tiene que ser mayor que cero. Es decir, si el campo 34 (“Precio de la Barrera Superior”) es igual a “0” cero, entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero), y viceversa (Notar que es válido que los campos 34 y 35 sean ambos mayores que cero).

Adicionalmente, si el campo “36-Modalidad del Precio Barrera” es igual a “D”, entonces los campos 34 y 35, relativos a los Precios Barrera Superior e Inferior, ambos deben ser mayores que “0” (cero).

Asimismo, en caso que el campo 34 y este campo sean mayor a cero, entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al valor reportado en el campo 34.

36. Modalidad del Precio Barrera

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “I”, “D”, “O” o “N”.

Adicionalmente, si el campo “9-Tipo de Opción” es igual la clave “O”, entonces este campo debe ser distinto de la clave “N”.

37. 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 “opto2”.

En operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea diferente de la clave “O”), se debe cumplir lo siguiente:

- a) La clave de este campo debe ser igual a “13”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TIM” o “TIX”.
- b) Este campo debe ser igual a “14”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TDE” o “TDM”.
- c) Este campo debe ser igual a “15” o “17”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “ACE” o “ACM”.
- d) Este campo debe ser igual a “16” o “18”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a la clave “G01”.
- e) Este campo debe ser igual a “19”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “IAM” o “IAX”.
- f) Este campo Debe ser igual a “20”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a la clave “I99”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

- g) Este campo debe ser igual a “21”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente (distinto de las claves “979” y “990”) reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Divisas”.
- h) Este campo debe ser igual a “23”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Metales”.
- i) Este campo debe ser igual a “24”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Combustible”.
- j) Este campo debe ser igual a “25”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Producto Pecuario”.
- k) Este campo debe ser igual a “26”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Producto Agrícola”.
- l) Este campo debe ser igual a “27”, si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Índices sobre inflación”.
- m) Este campo debe ser igual a “49”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TRE” o “TRM”.
- n) Este campo puede ser igual a “28”, “50”, “51” o “52”, sin importar la clave que se reporte en el campo 24 (“Tipo de Subyacente”).
- o) Este campo debe ser igual a “28”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “SWP” o “FWD”.

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “9-Tipo de Opción” sea igual a la clave “O”), este campo debe ser igual a “22”, “50”, “51” o “52”.

38. Revisión de los “Parámetros Principales”

Este campo no podrá reportarse vacío. En el caso de operaciones que no formen parte de un paquete, es decir, aquellas que el campo 21 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a las claves “43”, “44”, “45”, “46” o “47”, “48”, “49” y “90”; entonces este campo debe ser igual a “N”.

Tratándose de operaciones que puedan formar parte de un paquete, es decir, aquellas que el campo 21 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea diferente a alguna de las claves “43”, “44”, “45”, “46” o “47”, “48”, “49” y “90”; entonces este campo puede ser igual a “S” o “N”.

39. 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.

40. Socio liquidador de la operación

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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

41. Cámara de Compensación o 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 40 (“Socio Liquidador de la Operación”) es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual 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 clave reportada corresponda a un Repositorio de Derivados.”

Adicionalmente, si el campo 40 (“Socio Liquidador de la Operación”) es distinto de “077000”, entonces este campo debe ser distinto de “90”.

42. 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 41 (“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 3 (“Clave de la Contraparte”), o iii) la clave “000111”.

Si el campo 41 (“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”.

43. Clave de confirmación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío.

44. Valor del Parámetro Delta

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq X \leq 1$).

45. 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 asignársele a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Concertación” (campo 4).

46. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

47. 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.

Complemento de la Sección II (paquetes de opciones celebradas en mercados no reconocidos)

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

Los registros enviados por cada institución en la Sección II, que en el campo 38 (Revisión de los Parámetros Principales) sean igual a “S”, debe reportarse en esta sección de complemento. Asimismo, los registros que en la Sección II tengan el campo 38 igual a “N”, no deben reportarse en esta sección de complemento.

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.

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 4) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 45).

2. Clave de la Contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave 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 14 “Código LEI de la institución”). Esta clave debe ser igual a la del campo 3 (Contraparte) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

3. Fecha de Concertación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta fecha es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de este “Complemento” con los correspondientes de la Sección II.

4. Número de Identificación de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de este “Complemento” con los correspondientes de la Sección II.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

5. Número del Periodo de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros, de forma tal que para una misma “Fecha de Concertación” (campo 3) y “Número de Identificación” (campo 4), dos o más registros no sean iguales en este campo.

6. Importe Base Aplicable al Periodo de Ejercicio

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

7. Fecha de Inicio del Período de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

Esta fecha debe ser mayor o igual al campo 5 “Fecha de Inicio del Período de Ejercicio” del registro correspondiente a la Sección II utilizando los tres campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 4) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 45), para relacionar los registros de este “Complemento” con los correspondientes de la sección II.

Adicionalmente, esta fecha debe ser mayor o igual que la fecha del campo 8 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio”), en caso que el “Número del Periodo de Ejercicio” (campo 4) del registro que se está validando sea el inmediato anterior del registro correspondiente. Por ejemplo, si el registro que se está validando es igual a “3” en el campo 5 (“Número del periodo de ejercicio”), entonces este campo debe ser mayor o igual a la “Fecha de Término del Periodo de Ejercicio” (campo 8) del registro cuyo campo 5 (“Número del periodo de ejercicio”) sea igual a “2”.

8. Fecha de Término del Período de Ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Adicionalmente esta fecha debe ser mayor que la del campo 7 (“Fecha de Inicio del Periodo de Ejercicio”).

9. Tipo de Subyacente

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que sea no vacío, la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

10. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío.

En caso que la clave del campo 9 (“Tipo de Subyacente”) corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a “TIC”), un índice accionario (sea igual a “IAM” o “IAX”), un título de deuda (sea igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés variable (sea igual a “TIM” o “TIX”), un título

Uso Público

Información de acceso público.

representativo de capital (sea igual a “ACM” o “ACE”), o un título referenciado a acciones (sea igual a “TRM” o “TRE”), la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

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 “9-Tipo de Subyacente”. Por ejemplo, si el valor de este campo es igual a “USDMXN”, que de acuerdo a la columna “clase_subyacente” del Anexo AF es igual a “Divisas”, este valor debe ser igual al que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo “9-Tipo de Subyacente” es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 9 (“Tipo de Subyacente”) es distinta de un tipo de cambio (no es igual a “TIC”), un índice accionario (no es igual a “IAM” o “IAX”), un título de deuda (no es igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés variable (no es igual a “TIM” o “TIX”), un título representativo de capital (no es igual a “ACM” o “ACE”) o un título referenciado (no es igual a “TRM” o “TRE”), este campo deberá ser igual a “NA” (No aplica).

Si el campo 9 (“Tipo de Subyacente”) está vacío, este campo debe ser igual a “NA”.

11. Precio Unitario o Tasa de Ejercicio

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

12. Precio de la Barrera Superior

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

13. Precio de la Barrera Inferior

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

Asimismo, en caso que el campo 12 y este campo sean mayor a cero, entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al valor reportado en el campo 12.

14. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

B. VALIDACIÓN PARA TODOS Y CADA UNO DE LOS REGISTROS:

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Para cada registro, los siguientes campos no pueden ser simultáneamente vacíos o con “0” (cero), al menos uno debe ser no vacío o mayor a “0” (cero): a) 6-Importe Base Aplicable al Periodo de Ejercicio, b) 9-Tipo de Subyacente, c) 11-Precio Unitario o Tasa de Ejercicio, d) 12-Precio de la Barrera Superior y e) 13-Precio de la Barrera Inferior.

Sección III.- Operaciones con títulos opcionales (“Warrants”)

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. Oficina que realiza la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Anexo A.

Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución tenga “Agencias o Sucursales en el Extranjero” (conforme al “Catálogo de Instituciones con Agencias y/o Sucursales en el Extranjero”, si la institución del campo 1 no aparece en dicho catálogo, entonces este campo no puede ser igual a “A”).

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 que la clave de institución (del campo 1) corresponda a una institución de banca múltiple (campo 1 inicia con “040”), una institución de banca de desarrollo (campo 1 inicia con “037”), una casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o una SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

3. Origen de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe aceptar únicamente las claves “P” o “T”.

4. Clave de la persona cliente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave de la “Persona Cliente” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, si el campo 3 (“Origen de la operación”) es igual a “P” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 21 (“Código LEI de la institución”). En caso que el campo 3 (“Origen de la operación”) sea igual a “T” este campo debe ser distinto a la clave del campo 21 (“Código LEI de la institución”). Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

5. Clave de la Contraparte

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave 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 21 (“Código LEI de la institución”).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Adicionalmente, la clave de este campo debe ser distinta de la clave reportada en el campo “4-Clave de la persona clienta”.

Si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del segundo párrafo del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI.

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

6. Fecha de Concertación de la Colocación o Adquisición

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

7. Fecha de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor o igual que la “Fecha de Concertación de la Colocación o Adquisición” (campo 6) y corresponder a un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

En caso que la fecha del campo 7 (“Fecha de liquidación”) sea mayor que la del campo 6 (“Fecha de Concertación de la Colocación o Adquisición”), la diferencia no debe ser mayor en ocho días hábiles bancarios.

8. Posición en la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”.

9. Clave del Título Opcional

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave del título opcional (“Warrant”) que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Títulos Opcionales” a que se refiere el Anexo AB.

10. Objetivo de la Operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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.

11. Número de Título Opcionales Colocados o Adquiridos

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que “1” (uno).

12. Importe de la Prima (Total)

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

13. Moneda en que esta expresada la prima

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el “Anexo E”.

En caso que el campo 12 (“Importe de la Prima Total”) sea mayor que “0” (cero), este campo debe ser distinto de las claves “0”, “102”, “979” y “990”.

En caso que el campo 12 (“Importe de la Prima Total”) sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

14. 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.

15. Socio liquidador de la operación

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. Adicionalmente, si el campo 16 (“Cámara de Compensación o Repositorio de Derivados”) es igual a “90”, entonces este campo debe ser igual a “077000”.

16. Cámara de Compensación o 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 15 (“Socio Liquidador de la Operación”) es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual 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 clave reportada corresponda a un Repositorio de Derivados.”

Adicionalmente, si el campo 15 (“Socio Liquidador de la Operación”) es distinto de “077000”, entonces este campo debe ser distinto de “90”.

17. Clave de confirmación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío.

18. Valor del Parámetro Delta

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq X \leq 1$).

19. Número de Identificación de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Concertación de la Colocación o Adquisición” (campo 6).

20. Número de Identificación de la Opción de Cobertura

Este campo puede reportarse vacío.

21. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección IV.- 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 IV (en su respectiva fecha de vencimiento anticipado, cesión de derechos o terminación o extinción) deben haber sido enviadas previamente en la Sección II o III 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 II o III, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 4 para Sección II, y campo 6 para Sección III) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 45 para Sección II, y campo 19 para Sección III).

2. Fecha de Concertación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta fecha es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección IV con los correspondientes de la Sección II o III, según corresponda.

3. Sección a la que corresponde la Operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual a las claves “2” o “3”. En caso que el registro de esta sección sea igual a “2” o “3”, la operación que se debe relacionar (conforme a los tres campos “llave”) debe estar en la base de datos transaccional de la Sección “II” o “III”, según corresponda.

4. Fecha de Vencimiento Anticipado

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se reporte debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero), y ser mayor que la “Fecha de concertación” (campo 2).

Adicionalmente, la fecha de este campo debe ser menor que la “Fecha de Término del Periodo de Ejercicio” (campo 6 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”.

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

Cuando el campo “3-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “2” el valor de este campo debe ser menor o igual al campo “12-Importe Base del Contrato” 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 IV. En caso de que sea mayor a dicho campo 12, se deberá mostrar el siguiente mensaje de error grave: “El Importe por el vencimiento anticipado o cesión de derechos de la operación (Campo 7 de la Sección IV) es superior al importe base o de referencia (Campo 12) 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”.

Asimismo, cuando el campo “3-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “3”, el valor de este campo debe ser menor o igual al correspondiente valor nominal de los títulos reportados en el campo “11- número de títulos opcionales colocados o

Uso Público

Información de acceso público.

adquiridos” del registro de la Sección 3, 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 IV, considerando los vencimientos y ejercicios parciales si fuese el caso. En caso de que 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 (Campo 7 de la Sección IV) es superior al número de títulos opcionales colocados o adquiridos (Campo 11) del registro de la Sección 3, que tiene en posición, considerando 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 comunicarse al correo electrónico derivados@banxico.org.mx”.

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 IV 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 IV 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 cuando en el campo “3-Sección a la que corresponde la Operación” sea igual a “2”: Si el campo 12 es igual a “VP”, el valor numérico de este campo 9 debe ser mayor que el campo 7.

Por su parte, si el campo 12 es distinto de “VP”, este campo debe ser igual a cero (“0”). 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 “12-Importe Base o de Referencia” 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 IV. Adicionalmente, cuando el campo “12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” y en caso que

Uso Público

Información de acceso público.

en la base de datos de la Sección IV 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 IV 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 "12- Importe Base o de Referencia" 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 "12-Importe Base o de Referencia" y su correspondiente sumatoria de vencimientos parciales ("VP") entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total ("VT" en el campo 12).

Asimismo, cuando en el campo "3-Sección a la que corresponde la Operación" sea igual a "3": Si el campo 12 es igual a "VP", el valor numérico de este campo 9 debe ser mayor que el campo 7. Por su parte, si el campo 12 es distinto de "VP", este campo debe ser igual a cero ("0"). 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- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" del registro de la Sección III, 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 IV. 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 IV 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 IV 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- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" de la Sección III 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- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" y su correspondiente sumatoria de vencimientos parciales ("VP") entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total ("VT" en el campo 12).

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 valor del 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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”.

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 2 “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 IV 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 IV si existe algún registro que tenga los mismos tres campos “llave” (campo 1 “clave de la institución”, campo 2 “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 “4-Fecha de Vencimiento Anticipado” de dicho registro sea menor al valor del campo 4 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 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 IV si existe algún registro que tenga los mismos tres campos “llave” (campo 1 “clave de la institución”, campo 2 “fecha de concertación” y campo 13 “número de identificación de la operación (original)”) cuyo campo 4 “Fecha de Vencimiento Anticipado” sea igual al campo 4 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”, y el campo “3-Sección a la que corresponde la Operación” sea igual a “2”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo “12-Importe Base del Contrato” 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 IV. 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 IV existan dos o más registros que tengan los mismos tres campos “llave”

Uso Público

Información de acceso público.

(clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación) que el registro que se está reportado en esta Sección IV 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 "12-Importe Base o de Referencia" 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).

Por su parte, cuando el campo "12-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos" sea igual a "VP", y el campo "3-Sección a la que corresponde la Operación" sea igual a "3", entonces el valor de este campo debe ser menor al campo "11- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" del registro de la Sección 3, 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 IV. 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 IV 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 reportando en esta Sección IV y cuyo campo 12 también sea igual a 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- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" de la Sección III 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 "11- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" 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 asignársele a dos o más registros que tengan la misma "Fecha de concertación" (campo 4 para la Sección II, o 6 para la Sección III). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos "llave" para relacionar los registros de esta Sección IV, con los correspondientes de las Secciones II o III.

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" o "EX".

Uso Público

Información de acceso público.

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”.

15. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

16. 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 o IX conforme al campo 3, sección a la que corresponde la operación), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 13). Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 3) es igual a 3, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

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

17. 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.

Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 3) es igual a 3, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

Por otro lado, el identificador que se registre en este campo deberá encontrarse en la Sección II o IX conforme al campo 3, sección a la que corresponde la operación, de acuerdo a los campos: institución, fecha de vencimiento anticipado (campo 4), número de identificación de la nueva operación (campo 13).

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

Uso Público

Información de acceso público.

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 V.- Información del ejercicio de opciones celebradas tanto en Mercados Reconocidos como en Mercados No Reconocidos (incluyendo títulos opcionales o “Warrants”)

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

Las operaciones que la institución envíe en la Sección V (en su respectiva fecha de ejercicio) deben haber sido enviadas previamente en la Sección I, II, III o IX, 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, II, III o IX, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 4 para Sección II, y campo 6 para Secciones I y III, campo 5 para la sección IX) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 14 para la Sección I, campo 45 para la Sección II, campo 19 para la Sección III y campo 95 para sección IX).

2. Origen de la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P” o “T”. En caso de que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” sea igual a “2” o “9”, entonces la clave de este campo debe ser igual “P”.

En caso de que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” sea igual a “1”, la clave de este campo debe ser igual a la del campo 3 (“Origen de la Operación”) de la Sección I, que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 6) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 14).

Por su parte, en caso de que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” sea igual a “3”, la clave de este campo debe ser igual a la del campo 3 (“Origen de la Operación”) de la Sección III, que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la Institución” (campo 1), “Fecha de concertación de la Colocación o Adquisición” (campo 6) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 19).

3. Clave de la persona cliente

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave de la “Persona Cliente” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, si el campo 2 (“Origen de la operación”) es igual a “P”, entonces la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 11 (“Código LEI de la Institución”).

En caso de que el campo 2 (“Origen de la operación”) sea igual a “T” este campo debe ser distinto a la clave del campo 11 (“Código LEI”). Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

4. Fecha de Concertación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta fecha es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección V con los correspondientes de la Sección I, II, III o IX, según corresponda.

5. Sección a la que corresponde la Operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual exclusivamente a las claves “1”, “2”, “3” o “9”. En caso de que el registro de esta Sección sea igual a “1”, “2”, “3” o “9”, la operación que se debe relacionar (conforme a los tres campos “llave”) debe estar en la base de datos transaccional de la Sección “I”, “II”, “III” o “IX”, según corresponda.

6. 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, II, III o IX), 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 4). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección V, con los correspondientes de las Secciones I, II, III o IX.

7. Fecha de Ejercicio de la Operación

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 4).

Adicionalmente, la fecha de este campo debe ser menor o igual que la “Fecha de Término del Periodo de Ejercicio” (campo 6 de la sección II) de la operación que tenga los mismos campos “llave” en la sección II.

8. Precio Unitario o Tasa de Ejercicio

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

Si el campo “21-La operación es parte de una Operación Estructurada o Paquete” de la operación, con los mismos campos “llave” en la Sección II, es igual a las claves “10” u “11”, entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero). En cualquier otro caso deberá ser “0” (cero).

9. Importe ejercido en la operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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

Asimismo, cuando el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “2” o “9”, el campo “10- Moneda del importe ejercido en la operación” de esta sección sea igual al campo “13-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 2 o igual al campo “16-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 9, y el campo 38 "Revisión de los parámetros principales" sea igual a "N" o el campo "84-Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 9, entonces el valor de éste campo debe ser menor o igual al campo “12-Importe Base del Contrato” del registro de la Sección 2 o menor o igual al campo “15-Importe Base del Contrato” del registro de la Sección 9, 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 V.

En caso que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “2” o “9”, el campo “10- Moneda del importe ejercido en la operación” de esta sección sea igual al campo “13-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 2 o igual al campo “16-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 9, y el campo 38 "Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 2 sea igual a "S" o el campo "84-Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 9 sea igual a "S", entonces se deberá revisar el Complemento de la Sección 2 (o complemento de la Sección 9) en la fecha de ejercicio que corresponda (utilizando los campos 7 y 8 del Complemento sección 2, o los campo 6 y 7 del Complemento sección 9) y el valor de este campo (campo "9-Importe ejercido en la operación") debe ser menor o igual al campo "6-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento Sección 2 (campo "5-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento Sección 9) siempre y cuando este valor sea mayor a "0" (cero) y 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 V. Sin embargo, la revisión de los campos 7 y 8 del Complemento de la Sección 9 deberá realizarse de la siguiente manera:

- 1) Si el campo “13.- Modalidad de liquidación al ejercicio” es igual a “E” (Sección 9), entonces el campo “5. Fecha de ejercicio de la Operación” (Sección V) deberá ser mayor que el campo “6. Fecha de inicio del período de ejercicio” (complemento de la Sección 9) y menor o igual que el campo “7. Fecha de término del período de ejercicio” (complemento de la Sección 9)
- 2) Si el campo “13.- Modalidad de liquidación al ejercicio” es distinto a “E” (Sección 9), entonces el campo “5. Fecha de ejercicio de la Operación” (Sección V) deberá ser mayor o igual que el campo “6. Fecha de inicio del período de ejercicio” (complemento de la Sección 9) y menor o igual que el campo “7. Fecha de término del período de ejercicio” (complemento de la Sección 9)

En caso que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “2” o “9”, el campo “10- Moneda del importe ejercido en la operación” de esta sección sea igual al campo “13-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 2 o igual al campo “16-Moneda del importe base o de referencia” del registro de la Sección 9, y

Uso Público

Información de acceso público.

el campo 38 "Revisión de los parámetros principales" de la Sección 2 sea igual a "S" o el campo "84-Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 9 sea igual a "S", entonces se deberá revisar el Complemento de la Sección 2 (o complemento de la Sección 9) en la fecha de ejercicio que corresponda (utilizando los campos 7 y 8 del Complemento sección 2, o los campos 6 y 7 del Complemento sección 9) y si el campo "6-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento sección 2 es igual a "0" (cero) (campo "5-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento Sección 9), entonces el valor del campo "9-Importe ejercido en la operación" debe ser menor o igual al campo "12-Importe Base del Contrato" del registro de la Sección 2 (campo "15-Importe Base del Contrato" del registro de la Sección 9), 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 V.

En cualquier otro caso, es decir cuando el campo "5-Sección a la que corresponde la Operación" de esta sección sea igual a "2" o "9" y el campo "10- Moneda del importe ejercido en la operación" de esta sección no sea igual al campo "13-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 2 (campo "16-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 9), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: "Favor de confirmar la moneda del importe ejercido conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente.

Por su parte, cuando el campo "5-Sección a la que corresponde la Operación" sea igual a "3", entonces el valor de este campo debe ser menor o igual al campo "11- Número de títulos opcionales colocados o adquiridos" del registro de la Sección III, 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 V.

Por su parte, cuando el campo "5-Sección a la que corresponde la Operación" sea igual a "1", entonces el valor de este campo debe ser menor o igual al campo "10- Número de contratos" del registro de la Sección 1, 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 V.

En caso de que el valor del campo "16. Importe ejercido parcial" sea mayor a cero, entonces el valor del campo "9. Importe ejercido en la operación" deberá ser igual a cero.

10. Moneda del importe ejercido en la operación

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. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

12. Tipo de subyacente ejercido.

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea no vacío, la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

En caso de operaciones distintas a canastas de subyacentes, el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

13. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio.

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser distinta de vacío, la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

Adicionalmente, si este campo es distinto de vacío y si el valor del campo 50 (“Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo De Cambio”) al realizar el cruce con la Sección IX usando los campos llaves “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 95) y si el valor del campo 50 (“Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo De Cambio”) corresponde a una canasta de subyacentes, el valor de este campo deberá coincidir con alguno de los valores reportados en el campo “3. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” de la Sección XI. Para identificar si se trata de una canasta, el valor del campo 50 (“Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo De Cambio”) al cruzarlo con el catálogo “AF”, el campo “suby” deberá ser igual a “G01”, “I99”, “CTE”, “CDM” o “CDE”.

14. Valor del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser numérico y positivo.

15. Forma de liquidación

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso de operaciones reportadas en la Sección IX cuyo valor del campo 17 (“Forma de liquidación”) sea igual a la clave “M” (registros que tengan la misma clave de “Clave de la institución”, “Fecha de concertación” y “Número de identificación”), entonces el valor de este campo deberá ser igual a “S” o “D”.

En el caso de operaciones reportadas en la Sección IX cuyo valor del campo 17 (“Forma de liquidación”) sea distinto a la clave “M” (registros que tengan la misma clave de “Clave de la institución”, “Fecha de concertación” y “Número de identificación”), entonces el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

16. Importe ejercido parcial

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

En caso de que el campo “5-Sección a la que corresponde la Operación” de esta sección sea igual a “2” o “9”, el campo “10- Moneda del importe ejercido en la operación” de esta sección

Uso Público

Información de acceso público.

sea igual al campo "13-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 2 o igual al campo "16-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 9 , y el campo "38-Revisión de los parámetros principales" sea igual a "N" del registro de la Sección 2 o el campo "84-Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 9 , entonces el valor de éste campo debe ser menor al campo "12-Importe Base del Contrato" del registro de la Sección 2 o menor al campo "15-Importe Base del Contrato" del registro de la Sección 9, 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 V.

En caso de que el campo "5-Sección a la que corresponde la Operación" de esta sección sea igual a "2" o "9" , el campo "10- Moneda del importe ejercido en la operación" de esta sección sea igual al campo "13-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 2 o igual al campo "16-Moneda del importe base o de referencia" del registro de la Sección 9 , y el campo "38-Revisión de los parámetros principales" sea igual a "S" del registro de la Sección 2 o el campo "84-Revisión de los parámetros principales" del registro de la Sección 9 , entonces se deberá revisar el Complemento de la Sección 2 (o complemento de la Sección 9) en la fecha de ejercicio que corresponda (utilizando los campos 7 y 8 del Complemento sección 2, o los campo 6 y 7 del Complemento sección 9) y el valor de este campo (campo "9-Importe ejercido en la operación") debe ser menor al campo "6-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento Sección 2 (campo "5-Importe base aplicable al período de ejercicio" del Complemento Sección 9) siempre y cuando este valor sea mayor a "0" (cero) y 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 V.

En caso de que el valor del campo "9. Importe ejercido en la operación" sea mayor a cero, entonces el valor de este campo deberá ser igual a cero.

17. 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 o IX conforme al campo 5, sección a la que corresponde la operación), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 4) y número de identificación de la operación (campo 6). Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 5) es igual a 1 o 3, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

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

Sección VI.- Convalidación de opciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados reconocidos

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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 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

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), “Clave de la persona cliente” (campo 3), “Fecha de Corte” (campo 4), “Posición por Pizarra” (campo 5), “Clave de Pizarra” (campo 6) y “Socio Liquidador” (campo 7).

2. Origen de la Posición

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P” o “T”. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 3 (“Origen de la Operación”) de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

3. Clave de la persona cliente

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave de la “Persona Cliente” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B.

Adicionalmente, si el campo 2 (“Origen de la Posición”) es igual a “P” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 15. En caso que el campo (“Origen de la Posición”) sea igual a “T” este campo debe ser distinto a la clave del campo 15 (“Código LEI de la Institución”). Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

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. Posición por pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 5 (“Posición por Pizarra”) de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

6. Clave de pizarra

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 12 (“Clave de pizarra”) de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

En caso que el campo “Clave de Pizarra” contenga el carácter “-”, deberá extraerse la subcadena anterior a dicho carácter. El resultado debe estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA.

Uso Público

Información de acceso público.

7. Socio liquidador

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, dos o más registros no podrán tener la misma “Fecha de corte” (campo 4), “Clave de pizarra” (campo 6) y “Socio liquidador” (campo 7).

8. Número de Contratos Vigentes (Abiertos) en Posición

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

9. Objetivo de la Posición

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.

10. La posición es parte de un “paquete”, conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser igual a “0” (cero) o “1” (uno).

11. Valor de la Volatilidad Implícita

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

12. Valor del Parámetro Delta

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq X \leq 1$).

13. Importe Actualizado (Mercado) de la Prima (Total)

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

14. 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.

15. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Sección VII.- Convalidación de opciones 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 VII 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 Concertación” (campo 2) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4).

2. Fecha de concertación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

3. 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 debe ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a convalidar de que se trate. Adicionalmente, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de concertación de la operación (campo 2).

4. 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 2). 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.

5. 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.

6. Valor de la Volatilidad Implícita

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

7. Valor del Parámetro Delta

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq X \leq 1$).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

8. La operación es parte de un “Paquete” conforme a la C.U.B. o a la C.U.C.B.

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser igual a: “0” (cero) o “1” (uno).

Este campo puede ser igual a “1”, si el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) de la operación vigente a convalidar, conforme a los campos “llave”, es igual a “TIM” o “TIX”.

Si para la operación vigente a convalidar (conforme a los campos “llave”), el campo 24 (“Tipo de Subyacente”) es distinto de “TIM” o “TIX”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

9. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de un “Paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 8 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “1”, este campo debe ser distinto de “NA”.

En caso que el campo 8 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “0” (cero), este campo debe ser igual a “NA”.

10. Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de un “Paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Corte” (campo 3), y “Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo Paquete” (campo 9).

En caso que el campo 8 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “1”, el valor numérico debe iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros.

En caso que el campo 8 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “0” (cero), y por tanto, el campo 9 (“Clave o Folio con el que se identifica al Conjunto de Operaciones que forman un Paquete”) sea igual a “NA”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

11. Importe Actualizado (Mercado) de la Prima (Total)

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

12. Clave o folio para identificar los activos que constituyen la garantía de la operación

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.

Uso Público

Información de acceso público.

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”.

13. 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.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

14. 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 OPTO, de acuerdo a los campos llave: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 4).

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

Sección VIII.- Convalidación de operaciones con títulos opcionales (“warrants”) vigentes a la fecha de corte

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO

Los registros que la institución reporte en esta Sección VIII deben corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con los registros de la Sección III 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 III enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Clave de la persona cliente” (campo 3), “Fecha de Corte” (campo 4) y Clave del Título Opcional (campo 5).

2. Origen de la Posición

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “P” o “T”. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 3 (“Origen de la Operación”) de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

3. Clave de la persona clienta

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave de la “Persona Clienta” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B.

Adicionalmente, si el campo (“Origen de la Posición”) es igual a “P” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo 12. En caso que el campo 2 (“Origen de la Posición”) sea igual a “T” este campo debe ser distinto a la clave del campo 12 (“Código LEI de la Institución”). Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

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. Clave del Título Opcional

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Títulos Opcionales” a que se refiere el Anexo AB. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 9 (“Clave del Título Opcional”) de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

6. Número de Títulos Opcionales en Posición

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

7. Objetivo de la Posición.

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.

8. Valor de Mercado de los Títulos Opcionales en Posición

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

9. Valor de la Volatilidad Implícita

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

10. Valor del Parámetro Delta

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser menor o igual a uno y mayor o igual a menos uno ($-1 \leq X \leq 1$).

11. Importe Actualizado de la Prima (Total)

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

12. 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”.

Uso Público

Información de acceso público.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018, este campo deberá reportarse vacío.

Sección IX.- Opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato.

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. Oficina que realiza la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Matriz, Agencias y Sucursales o Filiales en el Extranjero” a que se refiere el Anexo A.

Se podrá anotar “A” sólo cuando la institución tenga “Agencias o Sucursales en el Extranjero” (conforme al “Catálogo de Instituciones con Agencias y/o Sucursales en el Extranjero”, si la institución del campo 1 no aparece en dicho catálogo, entonces este campo no puede ser igual a “A”). 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 que la clave de institución (del campo 1) corresponda a una institución de banca múltiple (campo 1 inicia con “040”), una institución de banca de desarrollo (campo 1 inicia con “037”), una casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o una SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

3. 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.

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 segundo párrafo 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 3.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

El valor de este campo debe ser distinto a la clave reportada en el campo 1 ("Clave de la institución").

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 del período de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío y la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Adicionalmente, cuando el campo "13. Modalidad del ejercicio" sea igual a "A" o "B", la fecha registrada debe ser mayor o igual que la "Fecha de concertación" (campo 5). Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

En caso de que el campo "13. Modalidad del ejercicio" sea igual a "E", y el campo 45 ("La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete"") sea igual a "90", entonces la fecha registrada en este campo debe ser igual a la "Fecha de concertación" (campo 5).

Si el campo "13. Modalidad del ejercicio" es igual a "E", mientras que el campo 45 ("La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete"") es distinto de las claves "1", o "2", entonces la fecha registrada debe ser mayor o igual que la "Fecha de concertación" (campo 5).

7. Fecha de término del período de ejercicio, o fecha única de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor a la "Fecha de inicio del periodo de ejercicio" (campo 6). Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones

Este campo deberá ser distinto a la clave "1", "3", "6" y "8" si el campo "56. Sección del formulario "SWAPS" a la que pertenece la operación SWAP" es distinto de vacío.

Este campo deberá ser distinta a la clave "1" y "8" si el campo "55. Número de identificación de la operación derivada subyacente" es distinto de vacío.

Este campo deberá ser igual a "8" si los campos 19 al 30 son diferentes de vacío.

9. Número de días hábiles para liquidar la operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser mayor o igual a cero. Si su valor es mayor que ocho (8), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar el número de días hábiles para liquidar la operación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

10. Posición en la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves “E” o “A”.

11. Tipo de opción

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves: “C”, “V”, “OC”, “OV” o “CH”.

Las siguientes validaciones deberán realizarse en caso de que existan dos registros que tengan las mismas claves en los siguientes campos: 1) campo 1, “Clave de la institución”; 2) campo 5, “Fecha de concertación”; 3) campo 45, “La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete””; y 4) campo 46, “Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”.

- 1) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “21”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” de ambos registros deberá ser igual a la clave “C”.
- 2) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “22”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” de ambos registros deberá ser igual a la clave “V”.
- 3) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “19”, “20”, “29” o “31”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” de un registro deberá ser igual a la clave “C” y el valor del campo “11. Tipo de opción” del otro registro deberá ser igual a “V”.
- 4) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “27”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” de un registro deberá ser igual al valor del campo del campo “11. Tipo de opción” del otro registro.

En caso de que el valor del campo 45 se igual a la clave “32”, y existan tres registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 (“Clave de la institución”), 2) campo 5 (“Fecha de concertación”), 3) campo 45 (“La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete””) y 4) campo 46 (“Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”), entonces:

- 1) El valor del campo “11. Tipo de opción” de dos registros deberá ser igual a “C” y el valor del campo “11. Tipo de opción” de un registro deberá ser igual a “V”.
- 2) El valor del campo “11. Tipo de opción” de dos registros deberá ser igual a “V” y el valor del campo “11. Tipo de opción” de un registro deberá ser igual a “C”.

En caso de que el valor del campo 45 se igual a la clave “33” o “35” y existan cuatro registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 (“Clave de la institución”), 2) campo 5 (“Fecha de concertación”), 3) campo 45 (“La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete””) y 4) campo 46 (“Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”), entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” de los cuatro registros deberá ser igual a “C” o igual a “V”.

Uso Público

Información de acceso público.

12. Tipo de opción dos

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, debe aceptar únicamente las claves: “C”, “V”, “OC”, “OV” o “CH”. En caso de que el campo “11. Tipo de Opción” haya sido reportado con la clave “OC” u “OV”, y si este campo es distinto de vacío, este campo deberá ser igual a “OC” u “OV”. Asimismo, En caso de que el campo “11. Tipo de Opción” haya sido reportado con la clave distinta a “OC” u “OV”, este campo deberá ser igual a “C”, “V” o “CH” o vacío.

Las siguientes validaciones deberán ser realizadas En caso de que exista un único registro que tengan la misma clave de: 1) campo 1 (“Clave de la institución”), 2) campo 5 (“Fecha de concertación”) y 3) campo 46 (“Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”):

- 1) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “58” o “59”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” deberá ser igual a la clave “C” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” deberá ser vacío.
- 2) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “60” o “61”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” deberá ser igual a la clave “V” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” deberá ser vacío.
- 3) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “19”, “20”, “29” o “31”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” deberá ser igual a la clave “C” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” deberá ser igual a la clave “V”. Asimismo, también es válido que el valor del campo “11. Tipo de opción” sea igual a la clave “V” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” sea igual a “C”.
- 4) Si el valor del campo 45 es igual a la clave “27”, entonces el valor del campo “11. Tipo de opción” deberá ser igual a la clave “C” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” deberá ser vacío, o el valor del campo “11. Tipo de opción” deberá ser igual a la clave “V” y el valor del campo “12. Tipo de opción Dos” deberá ser vacío.

13. Modalidad del ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves: “A”, “E” o “B”.

En caso de que el valor de este campo sea igual a “B”, entonces el valor del campo “84. Revisión de los “parámetros principales” deberá ser igual a “S”.

14. 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.

15. Importe base o de referencia

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser mayor que cero.

Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea diferente de la clave “OC” u “OV”) cuya clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “49. Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Acción individual”, “Combustible”, “Metales”, “Producto Agrícola”, “Títulos deuda” o “Títulos referenciados”, y que el campo

Uso Público

Información de acceso público.

“57. Número de unidades del subyacente” sea mayor a “0” (cero), entonces el valor numérico de este campo deberá ser igual al resultado de multiplicar el valor del campo 57 (“Número de Unidades del Subyacente”) por el campo 59 (“Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”), siempre que precio este sea mayor que cero, y dividir entre mil. En caso de que no se cumpla dicha validación, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar el Importe base o de referencia, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), este campo debe ser mayor que “0” (cero).

16. Moneda del importe base o 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 y ser distinta de “0” (cero).

En el caso de opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sean diferentes de la clave “OC” u “OV”) con campo 49 (“Tipo de Subyacente”) igual a la clave “TIC” (es decir, el subyacente es un tipo de cambio), entonces la clave de este campo debe ser igual: i) al campo “58. Moneda del Subyacente”, ii) al campo “61. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio” o iii) al campo “66. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos”.

Adicionalmente, para las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sean diferentes de la clave “OC” u “OV”) cuya clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “49. Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Combustible”, “Metales”, “Producto Agrícola”, “Títulos deuda”, la moneda de este campo debe ser la misma que la moneda del campo “61. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”; siempre y cuando sea distinta de “0” (cero), o ser la misma que el campo “66. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos”; siempre y cuando estos sea distintos de “0” (cero).

En caso de que la clase de subyacente (el texto que corresponda, a la clave reportada en el campo “49. Tipo de Subyacente”, en la columna “clase_suby” del Anexo “F”) sea igual a: “Acción individual” o “Títulos referenciados”, y la moneda de este campo sea diferente a la moneda del campo “61. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio”, siempre y cuando esta última sea distinta de “0” (cero), o diferente que el campo “66. Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos”, siempre y cuando estos sean distintos de “0” (cero), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la Moneda del Precio Unitario o Tasa de Ejercicio, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Tratándose operaciones “binarias” o “digitales” (aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), 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).

17. Forma de liquidación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío y debe aceptar únicamente las claves “S”, “D” o “M”.

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), este campo debe ser igual a “D” o “S”.

- 1) Tratándose de operaciones en las que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 48) sea igual a: “13”, “17”, “18”, “19”, “20”, “22”, “27”, “50”, o “51”, entonces este campo debe ser igual a “D”.
- 2) En caso de que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 48) sea igual a: “23”, “24”, “25” o “26”, y este campo sea igual a “S”, se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.
- 3) Asimismo, cuando el campo “49. Tipo de Subyacente” sea igual a “TIC”, este campo debe ser igual a “D”.
- 4) Cuando en una misma operación, el campo “48. Tipo de Producto Derivado” sea igual a “21” y el campo “49. Tipo de Subyacente” sea distinto de “TIC”, entonces este campo debe ser igual a “S”.
- 5) En caso de que el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 48) sea igual a: “14”, “15”, “16”, “28”, “49” o “55”, este campo puede ser igual a “D” o “S”.
- 6) Sin embargo, si el campo “Tipo de Producto Derivado” (campo 48) es igual a “52” y este campo igual a “S” se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “Favor de verificar la modalidad de liquidación, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

18. Moneda de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E y debe ser distinta de las claves “0”, “102”, “979” y “990”.

Las siguientes validaciones aplican para opciones distintas a las “binarias” o “digitales”, es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea diferente de la clave “OC” u “OV”:

- 1) En caso de que el campo “Tipo de Subyacente” (campo 49) sea igual a “TIM” o “TIX”, entonces este campo debe ser igual al campo 16 (“Moneda del Importe Base o Referencia”).
- 2) En caso de que el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) sea igual a “979” (UDIS mexicanas), o “SMA” (Salario Mínimo Vigente en el D.F.), entonces este campo debe ser igual a “484” (Pesos mexicanos).
- 3) En caso de que el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) sea igual a “990” (Unidades de Fomento Chilenas), entonces este campo debe ser igual a “152” (Pesos chilenos).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

- 4) En caso de que el campo 49 ("Tipo de Subyacente") sea igual a alguna de las claves de la "32" a la "990", excepto "979" y "990," (es decir, el subyacente es una divisa), entonces la clave de este campo debe ser distinta de dicho campo 49 ("Tipo de subyacente").

19. Fecha de inicio del primer flujo a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío y la fecha de anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario.

20. Fecha de vencimiento del último flujo a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío y la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de inicio del primer flujo a recibir o entregar (campo 19). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven} - (Fe_{ini} + Nu_{flujo} * Int_{flujo})| \leq \text{al campo 23}$$

Donde,

Fe_ven es el valor de este campo,

Fe_ini es el valor del campo 19,

Nu_flujo es el valor del campo 22,

Int_flujo es el valor del campo 23 del registro.

21. Acuerdo de días inhábiles para cálculo de los flujos

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío y la clave que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Convención de Días Inhábiles para el Cálculos de los Flujos" a que se refiere el Anexo I.

22. Número total de flujos a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que uno. Adicionalmente, cuando este campo sea igual a "1", se debe mostrar la siguiente advertencia (o diagnóstico no grave): "Favor de confirmar el número de flujos a recibir con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente".

23. Intervalo del flujo a recibir o entregar

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío, y su valor numérico debe ser igual o mayor que uno. Adicionalmente, el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 ("Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio"), el campo 6 ("Fecha de Inicio de Período de Ejercicio").

En caso de que el campo 22 contiene el valor de "1", el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días de los campos 20 y 19.

Si este campo es mayor o igual que "730" se enviará el diagnóstico no grave "Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en el campo "23. Intervalo del flujo a recibir o entregar" de la Sección IX".

24. Tasa de referencia para determinar la tasa variable a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío.

Si el campo "30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar" es igual a cero, la clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el "Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio", a que se refiere el Anexo AF.

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija, es decir, si el campo "30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar" es distinto de cero y vacío, la clave que se anote en este campo debe ser igual a "NA" (equivalente a no aplica).

25. Intervalo de revisión de la tasa de referencia para determinar el importe del flujo a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío.

Si el campo "30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar" es igual a cero, el valor numérico de este campo deberá ser mayor que uno y menor o igual que el campo 23.

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija, es decir, si el campo "30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar" es distinto de cero y vacío, este campo deberá ser igual a "0" (cero).

Si el campo 27 es igual a "S01" lo reportado en este campo deberá de ser igual al campo 23.

26. Año comercial o año natural (recibir o entregar)

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", se aceptará únicamente las claves "C" o "N", según sea el caso.

27. Modalidad de la tasa de referencia para determinar el importe de los flujos a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo "8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones" sea igual a la clave "8", este campo no podrá ser vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Si el campo “30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” es igual a cero, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Modalidad de la Tasa de Referencia” a que se refiere el Anexo V, y ser distinta de “NA”.

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija, es decir, si el campo “30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” es distinto de cero y vacío, la clave que se anote en este campo debe ser igual a “NA” (equivalente a no aplica).

28. Factor aplicable a la tasa de referencia a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea igual a la clave “8”, este campo no podrá ser vacío, y el valor de este campo deberá ser mayor o igual que cero y menor o igual que tres (3).

Si el valor de este campo es igual a cero, entonces el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” deberá ser igual a la clave “8” y el campo “30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” deberá ser distinto de cero.

Adicionalmente, si el valor de este campo es distinto de cero y de vacío, y el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” es igual a la clave “8”, entonces el valor del campo 30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” deberá ser igual a cero.

29. Puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea igual a la clave “8”, este campo no podrá ser vacío, y el valor de este campo deberá contener alguno de los siguientes valores:

- a) Igual a “0”.
- b) Valores negativos mayores que menos cinco (-5), por ejemplo “-0.35”.
- c) Valores positivos menores que cinco (5), por ejemplo “0.35”.

Asimismo, En caso de que el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea igual a la clave “8” y el campo “30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” es distinto de cero, la clave que se anote en este campo debe ser igual a “0”.

30. Valor de la tasa fija a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea igual a la clave “8”, este campo no podrá ser vacío y el valor numérico de este campo debe ser igual o mayor que cero y menor que quince (15). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y En caso de que el valor reportado esté fuera del rango anterior debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar la tasa fija con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

31. Cálculo de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cálculo de liquidación” a que se refiere el Anexo AK.

Tratándose de operaciones “binarias” o “digitales” (aquellas en que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), este campo

Uso Público

Información de acceso público.

deberá ser igual a la clave 3 o 6. Asimismo, tratándose operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea diferente a la clave “OC” u “OV”), este campo deberá ser diferente de la clave 3.

Si el campo “17. Forma de liquidación” es igual a la clave “S”, este campo deberá ser igual a la clave 6.

32. Cálculo de liquidación dos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cálculo de liquidación” a que se refiere el Anexo AK.

Para aquellas operaciones donde el campo “12. Tipo de Opción dos” sea igual a la clave “OC” u “OV”, este campo deberá ser igual a la clave 3 o 6.

Para aquellas operaciones donde el campo “12. Tipo de Opción dos” sea diferente a la clave “OC” u “OV”, este campo deberá ser distinto a la clave 3.

Asimismo, para aquellas operaciones donde el campo “12. Tipo de Opción dos” sea diferente a la clave “OC” u “OV”, y si el campo “17. Forma de liquidación” es igual a la clave “S”, este campo deberá ser igual a la clave 6.

33. Factor aplicado a la forma de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser siempre positivo. En caso de que su valor sea menor o igual a 10, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el factor aplicado (en términos porcentuales) a la forma de liquidación reportada en el campo “31. Cálculo de liquidación””.

34. Diferencial aplicado a la forma de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y el valor de este campo deberá contener alguno de los siguientes valores:

- a) Igual a “0”.
- b) Valores negativos, por ejemplo “-0.098”.
- c) Valores positivos, por ejemplo “0.098”.

En caso de que su valor sea mayor o igual a 100, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el diferencial aplicado a la forma de liquidación reportada en el campo “31. Cálculo de liquidación””.

35. Factor aplicado a la forma de liquidación dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser siempre positivo. En caso de que el valor del campo “32. Cálculo de liquidación dos” sea diferente de “1” y el valor de este campo sea menor o igual a 10, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el factor aplicado (en términos porcentuales) a la forma de liquidación reportada en el campo “32. Cálculo de liquidación dos””.

Uso Público

Información de acceso público.

En caso de que el valor del campo “32. Cálculo de liquidación dos” sea igual a la clave “1”, el valor de este campo deberá ser igual a cero “0”.

36. Diferencial aplicado a la forma de liquidación dos

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que el valor del campo “32. Cálculo de liquidación dos” sea diferente de “1”, el valor de este campo deberá contener alguno de los siguientes valores:

- a) Igual a “0”.
- b) Valores negativos, por ejemplo “-0.098”.
- c) Valores positivos, por ejemplo “0.098”.

En caso de que su valor sea mayor o igual a 100, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el diferencial aplicado a la forma de liquidación reportada en el campo “32. Cálculo de liquidación dos””

37. Memoria del pago

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S”, “N” o “P”. En caso de que la clave reportada sea “P” se deberá enviar el complemento de la Sección IX utilizando los campos llave: “1. Clave de la institución”, “2. Fecha de concertación” y “95. Número de identificación”. En caso de que la clave reportada sea “P”, el campo “84. Revisión de los parámetros “principales”” deberá ser igual a “S”.

38. Condición de terminación anticipada o cancelación del pago del flujo

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de condición de terminación anticipada” a que se refiere el Anexo AL.

Las siguientes validaciones aplicarán En caso de que el valor de este campo sea diferente de “1”:

- 1) Si el valor del campo “39. Número de ocurrencias de la condición para la terminación anticipada o cancelación del pago del flujo” es mayor a “1”, el valor de este campo deberá ser distinto de la clave “2”.
- 2) El valor reportado en alguno de los campos “72. Modalidad del precio barrera” o “78. Modalidad del precio barrera dos” deberá ser diferente de las claves “N”, “UI”, “DI”, “UIP”, “DIP” o “IN”.

39. Número de ocurrencias de la condición para la terminación anticipada o cancelación del pago del flujo

Este campo no podrá reportarse vacío. Este campo deberá ser mayor a “1” (uno) En caso de que el campo “38. Condición de terminación anticipada o cancelación del pago del pago” sea distinto a “1” y “2”.

40. Existencia de tipo de cambio forward “Quanto”

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “S” o “N”.

Uso Público

Información de acceso público.

Las siguientes validaciones aplicarán a las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a la clave “OC” u “OV”):

- 1) Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea igual a una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby sea igual a “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “49. Tipo de Subyacente” sea igual a “Divisas” o “Tasas de interés”), entonces este campo deberá ser igual a “N”.
- 2) En caso de las operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby = “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “49. Tipo de Subyacente” sea diferente de “Divisas” o “Tasas de interés”) y que la “Moneda del Subyacente (campo 58) sea diferente de la “Moneda de Liquidación” (campo 18), entonces este campo debe ser igual a “S”. Si este campo es igual a “N”, cumpliéndose las mismas condiciones anteriores, el SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la existencia de un tipo de cambio predeterminado o “Quanto”, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.
- 3) Las operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa, o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, excepto clase_suby = “TIC”, que corresponda al subyacente reportado en el campo “49. Tipo de Subyacente” sea diferente de “Divisas” o “Tasas de interés”) y que la “Moneda del Subyacente (campo 58) sea igual a la “Moneda de Liquidación” (campo 18), entonces este campo debe ser igual a “N”.
- 4) Las operaciones cuyo subyacente sea a un tipo de cambio (es decir, cuando el campo “49. Tipo de Subyacente” sea igual a “TIC”), y que la “Moneda de Liquidación” (campo 18) sea distinta de: i) la “Moneda del Subyacente” (campo 58), ii) “Moneda del Precio” (campo 61), y la “Moneda del Precio dos (campo 66); entonces este campo debe ser igual a “S”. En caso de que la “Moneda de Liquidación” (campo 18) sea igual a: i) la “Moneda del Subyacente” (campo 58), ii) “Moneda del Precio” (campo 61), o la “Moneda del Precio dos (campo 66), entonces este campo debe ser igual a “N”.

Tratándose de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”) en las que la clave del campo “16. Moneda del Importe Base” sea diferente de la clave del campo “18. Moneda de Liquidación”, entonces este campo debe ser igual a “S”. En caso de que este campo sea igual a “N”, cumpliéndose las mismas condiciones anteriores, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar la existencia de un tipo de cambio predeterminado o “Quanto”, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

Tratándose de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”),

Uso Público

Información de acceso público.

cuando la clave del campo “16. Moneda del Importe Base” sea igual a la clave del campo “18. Moneda de Liquidación”, entonces este campo debe ser igual a “N”.

41. Tipo de cambio forward “Quanto”

En caso de que el campo “40. Existencia de Tipo de Cambio Forward Quanto” sea igual a “S”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor debe ser mayor que cero.

En caso de que el campo “40. Existencia de Tipo de Cambio Forward Quanto” sea igual a “N”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

42. Importe de la prima (total)

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

43. Moneda en que está expresada la prima

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E y ser distinto de las claves “0”, “102”, “979” y “990”.

44. Fecha de pago/cobro de la prima

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo “42. Importe de la Prima Total” sea mayor que “0” (cero), la fecha de este campo debe ser menor o igual a la fecha que resulte de sumar, la “Fecha de término del periodo de ejercicio” (campo 7) más el “Número de Días Hábiles para Liquidar la Operación” (campo 9). La suma anterior, campo 7 más campo 9, no deberá considerar como días hábiles ni los sábados ni los domingos, ni los días inhábiles bancarios (ya sea en México o en el extranjero).

Adicionalmente, la fecha de este campo debe ser mayor o igual a la “Fecha de concertación” (campo 5).

En caso de que el campo “42. Importe de la Prima Total” sea igual a “0” (cero), este campo debe reportarse vacío. En caso de que el campo “42. Importe de la Prima Total” sea distinto a “0” (cero), este campo debe ser mayor o igual a la “Fecha de concertación” (campo 5).

45. 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 “opto2”.

Las siguientes validaciones aplicarán a las operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a las claves “OC” u “OV”):

- 1) Las operaciones que tengan “1” o “2” en este campo, entonces el campo “48. Tipo de Producto Derivado” debe ser igual a “13”, “50”, “51” o “52”.
- 2) Las operaciones que tengan “3” o “4” en este campo, entonces el campo 48 (“Tipo de Producto Derivado”) debe ser distinto de “13”.
- 3) Las operaciones que tengan “16” en este campo, entonces el campo 48 (“Tipo de Producto Derivado”) debe ser igual a alguna de las claves siguientes: “16”, “18”, “20” o “52”.

Uso Público

Información de acceso público.

- 4) Las operaciones que tengan la clave “SWP” en el campo “49. Tipo de Subyacente”, entonces este campo debe ser igual a la clave “6”. Asimismo, si este campo es igual a la a la clave “6”, entonces el campo “49. Tipo de Subyacente” debe ser igual a la clave “SWP”.
- 5) Las operaciones que tengan la clave “FWD” en el campo “49. Tipo de Subyacente”, entonces este campo debe ser igual a la clave “7”. Asimismo, si este campo es igual a la a la clave “7”, entonces el campo “49. Tipo de Subyacente” debe ser igual a la clave “FWD”.

Para las operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas en que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes: “5”, “12”, “13”, “14”, “15”, “40”, “41”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “39”, entonces alguno de los campos “62. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción” o “67. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción dos”, deberá ser igual a la clave “4”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “10”, entonces alguno de los campos “62. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción” o “67. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción dos”, deberá ser igual a la clave “2”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “55”, entonces alguno de los campos “62. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción” o “67. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción dos”, deberá ser igual a la clave “8”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “11”, entonces alguno de los campos “62. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción” o “67. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción dos”, deberá ser igual a la clave “3”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “21” o “22” entonces deberán existir dos registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 (“Clave de la institución”), 2) campo 5 (“Fecha de concertación”), 3) campo 45 (“La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”) y 4) campo 46 (“Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”).

Cuando la clave del campo 45, “la operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’”, sea igual a “19”, “20”, “21”, “22”, “29” o “31” deberán:

- Existir dos registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46). Adicionalmente el campo “64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos” para estos registros debe ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

- En caso de que sólo exista un solo registro, excepto cuando la clave del campo 45 sea igual a la clave “21” o a la clave “22”, alguno de los campos indicados en la tabla siguiente no deberá tener el valor de la columna “Restricción”:

#	Campo	Restricción
64	Precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
65	Forma en la que está representado el precio de ejercicio Dos	“1” (uno)
66	Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
67	Cálculo para establecer el ejercicio de la opción Dos	“0” (cero)
68	Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio Dos	“0” (cero)
76	Precio de la barrera superior Dos	“0” (cero)
78	Modalidad del precio barrera Dos	“N”
79	Intervalo o frecuencia del monitoreo del o los precios barrera Dos	“0” (cero)
80	Fecha de inicio del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío
81	Fecha de término del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío

Cuando la clave del campo 45, “la operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’”, sea igual a “32”, “37” o a “38” deberán:

- Existir tres registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46). Adicionalmente el campo “64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos” para estos registros debe ser igual a “0” (cero).
- Deberán existir dos registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46), donde en uno de los registros, alguno de los campos indicados en la tabla siguiente no deberá tener el valor de la columna “Restricción”:

#	Campo	Restricción
64	Precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
65	Forma en la que está representado el precio de ejercicio Dos	“1” (uno)
66	Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
67	Cálculo para establecer el ejercicio de la opción Dos	“0” (cero)
68	Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio Dos	“0” (cero)
76	Precio de la barrera superior Dos	“0” (cero)
77	Precio de la barrera inferior Dos	“0” (cero)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Cuando la clave del campo 45, “la operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’”, sea igual a “33” o “34” deberán:

78	Modalidad del precio barrera Dos	“N”
79	Intervalo o frecuencia del monitoreo del o los precios barrera Dos	“0” (cero)
80	Fecha de inicio del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío
81	Fecha de término del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío

- Existir cuatro registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46). Adicionalmente el campo “64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos” para estos registros debe ser igual a “0” (cero).
- Deberán existir tres registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46), pero en uno de ellos el campo 33, Factor aplicado a la forma de liquidación, deberá ser igual a 200; o
- deberán existir dos registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46), adicionalmente en los dos registros, alguno de los campos indicados en la tabla siguiente no deberá tener el valor de la columna “Restricción”:

#	Campo	Restricción
64	Precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
65	Forma en la que está representado el precio de ejercicio Dos	“1” (uno)
66	Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
67	Cálculo para establecer el ejercicio de la opción Dos	“0” (cero)
68	Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio Dos	“0” (cero)
76	Precio de la barrera superior Dos	“0” (cero)
77	Precio de la barrera inferior Dos	“0” (cero)
78	Modalidad del precio barrera Dos	“N”
79	Intervalo o frecuencia del monitoreo del o los precios barrera Dos	“0” (cero)
80	Fecha de inicio del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío
81	Fecha de término del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío

Cuando la clave del campo 45, “la operación es parte de una ‘operación estructurada’ o ‘paquete’”, sea igual a “35” o a “36” deberán:

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

- Existir cuatro registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46). Adicionalmente el campo “64. Precio unitario o tasa de ejercicio Dos” para estos registros debe ser igual a “0” (cero).
- Deberán existir dos registros con la misma Clave o Folio de “paquete” (campo 46), adicionalmente en los dos registros, alguno de los campos indicados en la tabla siguiente no deberá tener el valor de la columna “Restricción”:

#	Campo	Restricción
64	Precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
65	Forma en la que está representado el precio de ejercicio Dos	“1” (uno)
66	Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio Dos	“0” (cero)
67	Cálculo para establecer el ejercicio de la opción Dos	“0” (cero)
68	Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio Dos	“0” (cero)
76	Precio de la barrera superior Dos	“0” (cero)
77	Precio de la barrera inferior Dos	“0” (cero)
78	Modalidad del precio barrera Dos	“N”
79	Intervalo o frecuencia del monitoreo del o los precios barrera Dos	“0” (cero)
80	Fecha de inicio del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío
81	Fecha de término del periodo de la ventana de la barrera Dos	vacío

En caso de que este campo sea igual a “89”, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar que el paquete o estructura deseada este comprendida en el Anexo “J””.

46. 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 45 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea distinta de “90”, en este campo debe registrarse una clave distinta de “NA”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío.

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 43 (“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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

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 46).

48. 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 “opto2”.

En operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sean distintas a la clave “OC” u “OV”), se debe cumplir lo siguiente:

- a) La clave de este campo debe ser igual a “13”, “28”, “50”, “51” o “52”, si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TIM” o “TIX”.
- b) Este campo debe ser igual a “14”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TDE” o “TDM”.
- c) Este campo debe ser igual a “15” o “17”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “ACE” o “ACM”.
- d) Este campo debe ser igual a “16” o “18”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a la clave “G01”.
- e) Este campo debe ser igual a “19”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “IAM” o “IAX”.
- f) Este campo Debe ser igual a “20”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a la clave “I99”.
- g) Este campo debe ser igual a “21”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente (distinto de las claves “979” y “990”) reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Divisas”.
- h) Este campo debe ser igual a “23”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Metales”.
- i) Este campo debe ser igual a “24”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Combustible”.
- j) Este campo debe ser igual a “25”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Producto Pecuario”.

Uso Público

Información de acceso público.

- k) Este campo debe ser igual a “26”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Producto Agrícola”.
- l) Este campo debe ser igual a “27”, “28”, “50”, “51” o “52” si el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a “Índices sobre inflación”.
- m) Este campo debe ser igual a “49”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “TRE” o “TRM”.
- n) Este campo debe ser igual a “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a las claves “SWP” o “FWD”.
- o) Este campo debe ser igual a “55”, “28”, “50”, “51” o “52” si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a la clave “CTE”.

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que el campo “11. Tipo de Opción” sea igual a la clave “OC” u “OV”), este campo debe ser igual a “22”, “50”, “51” o “52”.

49. Tipo de subyacente

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.

50. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que la clave del campo 49 (“Tipo de Subyacente”) corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a “TIC”), un índice accionario (sea igual a “IAM” o “IAX”), una canasta de índices accionarios (sea igual a “I99”), un título de deuda (sea igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés de referencia (sea igual a “TIM” o “TIX”), un título representativo de capital (sea igual a “ACM” o “ACE”), una canasta de acciones (sea igual a “G01”), una canasta de títulos referenciados (sea igual a “CTE”), o un título referenciado (sea igual a “TRM” o “TRE”), la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

En caso de que el valor de este campo sea distinto de “NA”, 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 “49. Tipo de Subyacente”.

Asimismo, si la clave del campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es igual a alguna de las claves siguientes: “IAM”, “IAX”, “I99”, “TDM”, “TDE”, “TIM”, “TIX”, “ACM”, “ACE”, “G01”, “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.

Uso Público

Información de acceso público.

Si la clave del campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es distinta de un tipo de cambio (no es igual a “TIC”), un índice accionario (no es igual a “IAM”, “IAX” o “I99”), un título de deuda (no es igual a “TDM” o “TDE”), una tasa de interés variable (no es igual a “TIM” o “TIX”), un título representativo de capital (no es igual a “ACM” o “ACE” “G01”)), una canasta de títulos referenciados (no sea igual a “CTE”), o un título referenciado (no es igual a “TRM” o “TRE”), este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

51. Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

En caso de que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 6 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”). En caso contrario, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el valor del intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”. Asimismo, su valor debe ser igual o mayor que el campo 52 (“Intervalo o frecuencia de monitoreo del Precio del Subyacente”).

En el caso de operaciones con modalidad de liquidación al ejercicio tipo “Bermuda” (campo “13. Modalidad del ejercicio” igual a “B”), entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

En el caso de operaciones que formen parte de un “paquete” con múltiples ejercicios posibles (es decir que el campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete”” sea igual a “1”, “2”, “3”, “4”, “5” o “27”), entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

52. Intervalo o frecuencia de monitoreo del precio del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

En caso de que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 6 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”). En caso contrario, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el valor del intervalo o frecuencia de monitoreo del Precio del Subyacente, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

En el caso de operaciones con modalidad de liquidación al ejercicio tipo “Europea” (campo “13. Modalidad del ejercicio” igual a “E”), cuyo campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”” sea distinto de la clave 39 y con ejercicios únicos (campo “54. Número Total de Posibles Ejercicios” igual a “1”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

En el caso de operaciones que monitorean el precio de mercado del subyacente (es decir, que el campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete” sea igual a “1”, “2”, “3”, “4”, “5” o “39”), entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

53. Número de días utilizado para la determinación del precio del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser igual o mayor a cero. En caso de que el valor del campo “62. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción” o del campo “67. Cálculo aplicable al precio de ejercicio para determinar el ejercicio de la opción dos” sea igual a la clave “4” o “7”, entonces el valor de este campo deberá ser mayor a cero “0”. Asimismo, En caso de que el valor del campo 62 o campo 67 sea igual a “1”, el valor de este campo deberá ser igual a cero “0”.

54. Número total de posibles ejercicios

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando la clave del campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete” sea igual a alguna de las claves de la “1” a la “5” y “27”, entonces este campo debe ser mayor o igual que “1” (uno) y menor o igual que 260.

En caso de que este campo sea mayor que 1, entonces el resultado de multiplicar este campo por el campo 51 (Intervalo o frecuencia de los posibles ejercicios) debe ser menor o igual al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 6 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”). En caso contrario, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el Número Total de Posibles Ejercicios, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

55. Número de identificación de la operación derivada subyacente o vinculada al conjunto de opciones

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el campo 49 (“Tipo de Subyacente) sea igual a la clave “FWD” o “SWP”, este campo debe tener una clave o folio que sea distinto de “NA” y diferente a vacío.

En caso de que el valor del campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea distinto de la clave “1” u “8”, este campo debe tener una clave o folio que sea distinto de vacío o de “NA”.

56. Sección del formulario “swaps” a la que pertenece la operación swap

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el que el valor del campo “8. Otro tipo de derivado vinculado al conjunto de opciones” sea igual de la clave “2”, “4”, “5” o “7”, este campo deberá ser igual a las claves “2”, “3” o “4”.

57. Número de unidades del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío.

Las siguientes validaciones aplicarán tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a la clave “OC” u “OV”):

Uso Público

Información de acceso público.

- 1) Las operaciones cuyo subyacente sea diferente de una divisa, un tipo de cambio, un “forward”, un “swap” o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo “49. Tipo de Subyacente” sea diferente de “Divisas”, “Derivados” o “Tasas de interés”), entonces este campo debe ser mayor o igual que uno.
- 2) Las operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio, un “forward”, un “swap” o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en “49. Tipo de Subyacente” sea igual a “Divisas”, “Derivados” o “Tasas de interés”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

En el caso de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”) este campo debe ser igual a “0” (cero).

58. Moneda del subyacente

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

Tratándose de operaciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a las claves “OC” u “OV”), cuyo subyacente sea una divisa (es decir que el campo “49. Tipo de Subyacente” sea igual a alguna de las claves de la “32” a “986”, excepto las claves “979” y “102”) entonces la moneda de este campo debe ser igual a la moneda del campo 16 (“Moneda del Importe Base o de Referencia”) y también debe ser igual a la clave del campo 49 (“Tipo de Subyacente”).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea igual a un índice accionario (es decir, que el “campo 49. Tipo de Subyacente” sea igual a “IAM” o “IAX”), un título de deuda (es decir, que el “campo 49. Tipo de Subyacente” sea igual a “TDM” o “TDE”), un título representativo de capital (es decir, que el “campo 49. Tipo de Subyacente” sea igual a “ACM” o “ACE”), o un título referenciado a acciones (es decir, que el “campo 49. Tipo de Subyacente” sea igual a “TRM” o “TRE”), o una tasa de interés (es decir, cuando el campo “49. Tipo de Subyacente” es igual a “TIM” o “TIX”), entonces este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda al subyacente registrado en el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”), conforme a la columna “mda_suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea un tipo de cambio (es decir, que el campo “49. Tipo de Subyacente” sea igual a “TIC”), entonces este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda a la clave del tipo de cambio registrado en el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”), conforme a la columna “suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.

Adicionalmente cuando el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”) sea igual a “NA” y la clave del campo 49 (“Clave del valor, índice accionario, tasa

Uso Público

Información de acceso público.

de interés o tipo de cambio”), corresponda a alguna de las siguientes clases de subyacente del catálogo "F" (en el campo "clase_suby"): "Producto Agrícola", "Combustibles" o "Metales", entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de la moneda que corresponda, conforme a la columna "mda_suby" del Anexo F .

59. Precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que "0" (cero) y menor que 400 mil.

En particular, si el campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" es igual a las claves "10", "11" o "55", entonces este campo debe ser igual a "0" (cero).

Tratándose de operaciones distintas a las "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas cuyo campo "11. Tipo de Opción" sea distinto de las claves "OC" u "OV"), donde el campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" es distinta a las claves "10", "11" o "55", entonces este campo debe ser mayor a "0" (cero).

Asimismo, si el campo "11. Tipo de Opción" es igual la clave "OC" u "OV", entonces este campo debe ser igual a "0" (cero).

Las siguientes validaciones deberán realizarse En caso de que existan dos registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 ("Clave de la institución"), 2) campo 5 ("Fecha de concertación"), 3) campo 45 ("La operación es parte de una "operación estructurada" o "paquete") y 4) campo 46 ("Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones"):

- 1) En caso de que el campo 45 sea igual a "19" o "27", entonces el valor del campo "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" de los dos registros deberá ser igual.
- 2) En caso de que el campo 45 sea igual a "20" o "31", entonces el registro cuyo campo "11. Tipo de opción" sea igual a "C", el valor del campo "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" de dicho registro deberá ser mayor al valor del "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" del otro registro.

En caso en que exista un registro con el campo 45 igual a "19" o "27", el campo "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" mayor que cero y el campo "64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos" mayor que cero, entonces el campo 59 y el campo 64 deben ser iguales.

60. Forma en la que está representado el precio de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Tipo de precio" a que se refiere el Anexo AM.

Si el campo "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" es igual a "0" (cero), y el campo "62. Cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción" es igual a la clave "2", "3" u "8", entonces el valor de este campo debe ser distinto de la clave "1".

Uso Público

Información de acceso público.

Si el campo “59. Precio unitario o tasa de ejercicio” es mayor a “0” (cero) y el campo “49. Tipo de Subyacente” es igual a la clave “IAM”, “IAX” o “I99”, entonces el valor de este campo debe ser igual a la clave “3” o “4”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “5”, entonces el campo “49. Tipo de Subyacente” deberá ser igual a la clave “CDE”, “CDM”, “CTE”, “G01” o “I99”.

61. Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de “Moneda” que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

Tratándose de opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a las claves “OC” u “OV”), si el valor del campo 59 (“Precio unitario o tasa de ejercicio”) es igual a “0” y el valor del campo 45 es igual a la clave “10”, “11” o “55”, entonces este campo deberá ser distinto a “0” (cero).

Las siguientes validaciones aplican para las opciones distintas a las “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas cuyo campo “11. Tipo de Opción” sea distinto a las claves “OC” u “OV”) y cuyo campo 59 (“Precio unitario o tasa de ejercicio”) sea mayor a “0” (cero); así como a las opciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas en que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean iguales a la clave “OC” u “OV”):

- a) En el caso de opciones con campo 49 (“Tipo de Subyacente”) igual a alguna de las claves de la “32” a la “990” (es decir, el subyacente es una divisa), entonces la clave de este campo debe ser distinta al campo 49 (“Tipo de Subyacente”).
- b) En caso de que el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”) sea distinto a “NA” y que el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) sea distinto a “IAM” o “IAX”, entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda a la clave registrada en el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”), conforme a la columna “mda_suby” del Anexo AF “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio”.
- c) Asimismo, cuando el campo 50 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”) sea igual a “NA”, la clave del campo “49. Tipo de Subyacente”, corresponda a alguna de las siguientes clases de subyacente del catálogo “F” (en el campo “clase_suby”): “Producto Agrícola”, “Combustibles” o “Metales”, entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de la moneda que corresponda, conforme a la columna “mda_suby” del Anexo F.

Adicionalmente, tratándose de operaciones “binarias” o “digitales” (es decir, aquellas que alguno o los dos campos “11. Tipo de Opción” y “12. Tipo de Opción dos” sean igual a la clave “OC” u “OV”), este campo deberá ser distinto de “0” (cero).

62. Cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Ejercicio” a que se refiere el Anexo AN.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Si el valor de este campo es igual a la clave “4”, entonces el valor del campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada” o “paquete”” deberá ser igual a la clave “39”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “2”, entonces el valor del campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete”” deberá ser igual a la clave “10”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “8”, entonces el valor del campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete”” deberá ser igual a la clave “55”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “3”, entonces el valor del campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete”” deberá ser igual a la clave “11”.

63. Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor debe ser mayor o igual a cero.

Si el valor del campo “62. Calculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción” es igual a la clave “2”, “3” u “8”, entonces este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser igual o mayor que “0” (cero) y menor que 400 mil.

En particular, si el campo “45. La operación es parte de una “operación estructurada o “paquete”” es igual a las claves “10”, “11” o “55”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Asimismo, si el campo “12. Tipo de Opción dos” es igual la clave “OC” u “OV”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Las siguientes validaciones deberán ser realizadas en caso de que exista un único registro que tengan la misma clave de: 1) campo 1 (“Clave de la institución”), 2) campo 5 (“Fecha de concertación”) y 3) campo 46 (“Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones”):

- 1) En caso de que el campo 45 sea igual a “19” o “27”, entonces el valor del campo “59. Precio unitario o tasa de ejercicio” y el valor de este campo deberá ser distinto a cero “0” e iguales.
- 2) En caso de que el campo 45 sea igual a “58”, “59”, “60” o “61”, entonces tanto el valor del campo “59. Precio unitario o tasa de ejercicio” como el de este campo deberán ser distintos a cero.
- 3) En caso de que el campo 45 sea igual a “20” o “31” el valor de este campo deberá ser distinto a cero. Adicionalmente, si el campo “11. Tipo de opción” sea igual a “C”, entonces el valor del campo “59. Precio unitario o tasa de ejercicio” deberá ser mayor al valor de este campo y este campo debe ser mayor a cero. Asimismo, bajo las mismas condiciones, pero el valor del campo “11. Tipo de opción” es igual a “V”, entonces el valor del campo “59. Precio unitario o tasa de ejercicio” deberá ser mayor a cero y menor al valor de este campo.

Uso Público

Información de acceso público.

Las siguientes validaciones deberán ser realizadas en caso de que existan dos únicos registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 ("Clave de la institución"), 2) campo 5 ("Fecha de concertación") y 3) campo 46 ("Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones"):

- 1) En caso de que el campo 45 sea igual a "32", "33", "34", "35", "36", "37", o a "38", entonces en uno de los registros tanto el valor del campo "59. Precio unitario o tasa de ejercicio" como el de este campo deberán ser distintos a cero.

Las siguientes validaciones deberán ser realizadas en caso de que existan tres únicos registros que tengan la misma clave de: 1) campo 1 ("Clave de la institución"), 2) campo 5 ("Fecha de concertación") y 3) campo 46 ("Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones"):

- 1) En caso de que el campo 45 sea igual a "33" o a "34", entonces el valor de este campo, para los tres registros, deberá reportarse igual a cero

65. Forma en la que está representado el precio de ejercicio dos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Tipo de precio" a que se refiere el Anexo AM.

Si el valor del campo "64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos" es mayor a cero y si el campo "49. Tipo de Subyacente" es igual a la clave "IAM", "IAX" o "I99", el valor de este campo debe ser igual a la clave "3" o "4".

Si el valor de este campo es igual a la clave "5", entonces el campo "49. Tipo de Subyacente" deberá ser igual a la clave "CDE", "CDM", "CTE", "G01" O "I99".

66. Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio dos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de "Moneda" que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E.

Para las opciones distintas a las "binarias" o "digitales" es decir, aquellas cuyo campo "11. Tipo de Opción" sea distinto de la clave "OC" u "OV"), si el precio Unitario o Tasa de Ejercicio dos (campo 64) es igual a "0" (cero) y el valor del campo 65 es igual a "1", entonces este campo debe ser igual a "0" (cero).

Las siguientes validaciones aplican para las opciones distintas a las "binarias" o "digitales" es decir, aquellas cuyo campo "11. Tipo de Opción" y "12. Tipo de Opción dos" sea distinto a las claves "OC" u "OV") cuyo campo "64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos" es distinto de "0" (cero); así como a las opciones "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas en que el campo "12. Tipo de Opción dos" sean iguales a la clave "OC" u "OV") cuyo valor de este campo sea distinto de "0" (cero):

- a) En el caso de opciones con campo 49 ("Tipo de Subyacente") igual a alguna de las claves de la "32" a la "990" (es decir, el subyacente es una divisa), entonces la clave de este campo debe ser distinta al campo 49 ("Tipo de Subyacente").

Uso Público

Información de acceso público.

- b) En caso de que el campo 50 ("Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio") sea distinto a "NA" y que el campo 49 ("Tipo de Subyacente") sea distinto a "IAM", "IAX", entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de moneda que corresponda a la clave registrada en el campo 50 ("Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio"), conforme a la columna "mda_suby" del Anexo AF "Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de cambio".
- c) Adicionalmente cuando el campo 50 ("Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio") sea igual a "NA", la clave del campo "49. Tipo de Subyacente", corresponda a alguna de las siguientes clases de subyacente del catálogo "F" (en el campo "clase_suby"): "Producto Agrícola", "Combustibles" o "Metales", entonces la clave de este campo debe ser igual a la clave de la moneda que corresponda, conforme a la columna "mda_suby" del Anexo F.

Tratándose de operaciones "binarias" o "digitales" (es decir, aquellas que alguno o los dos campos "11. Tipo de Opción" y "12. Tipo de Opción dos" sean igual a la clave "OC" u "OV"), cuyo campo "78. Modalidad del precio barrera dos" sea diferente de la clave "N", entonces este campo deberá ser distinto de "0" (cero).

67. Cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción dos

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Ejercicio" a que se refiere el Anexo AN.

Las siguientes validaciones aplican cuando el campo "64. Precio unitario o tasa de ejercicio dos" es distinto de "0" (cero):

- 1) Si el valor de este campo es igual a la clave "4", entonces el valor del campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" deberá ser igual a la clave "39".
- 2) Si el valor de este campo es igual a la clave "2", entonces el valor del campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" deberá ser igual a la clave "10".
- 3) Si el valor de este campo es igual a la clave "8", entonces el valor del campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" deberá ser igual a la clave "55".
- 4) Si el valor de este campo es igual a la clave "3", entonces el valor del campo "45. La operación es parte de una "operación estructurada o "paquete"" deberá ser igual a la clave "11".

68. Número de días utilizado para la determinación del precio de ejercicio dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor debe ser mayor o igual a cero.

Si el valor del campo "67. Cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción dos" es igual a la clave "2", "3" u "8", entonces este campo deberá ser mayor a "0" (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

69. Precio inicial del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser numérico y positivo. El valor del precio del subyacente deberá ser consistente con el comportamiento del mercado.

Adicionalmente, En caso de que para una operación en particular el precio del subyacente resulte negativo la institución deberá solicitar al Banco de México la apertura de la validación del sistema de acopio para el envío de dicho precio.

70. Precio de la barrera superior

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “72. Modalidad del precio barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, “UOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKROUP”, “DUKOIP”, “OUP”, “INP”, “OU” o “IN” el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “70. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “DI”, “DIP”, “DO” o “DOP”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

71. Precio de la barrera inferior

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “72. Modalidad del precio barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “70. Precio de la Barrera Superior” y el valor de este campo es mayor que “0” (cero), entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al reportado en el campo 70. Si el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” es igual a la clave “DI”, “DIP”, “DO”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKROUP”, “DUKOIP”, “OUP”, “INP”, “OU” o “IN” el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “70. “Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, o “UOP”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

72. Modalidad del precio barrera

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo “Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO. En caso de que alguno o los dos campos 70 y 71 sean distintos de cero “0”, entonces el valor de este campo debe ser distinto de la clave “N”.

Si el campo “11. Tipo de Opción” o campo “12. Tipo de Opción dos” es igual la clave “OC” u “OV”, entonces este campo debe ser distinto de la clave “N”.

Si el valor de este campo es igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKROUP” o “DUKOIP”, entonces deberá el campo “84. Revisión de los “parámetros principales”” deberá ser igual a “S”.

73. Intervalo o frecuencia de monitoreo del o los precios barrera

Uso Público

Información de acceso público.

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

En caso de que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces el valor numérico reportado debe ser menor o igual al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 6 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”).

Si el campo “72. Modalidad del precio barrera” es igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOIP”, “OUP”, “INP”, “OU” o “IN”, entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

Si el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” es igual a “N”, entonces este campo deberá ser igual a “0” (cero).

74. Fecha de inicio de la ventana de la barrera

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, En caso de que el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” sea igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOIP”, “OUP” o “INP”, el valor de este campo deberá ser diferente de vacío.

75. Fecha de término de la ventana

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, En caso de que el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” sea igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOU” o “DUKOIP”, el valor de este campo deberá ser diferente de vacío.

76. Precio de la barrera superior dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “78. Modalidad del precio barrera dos” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, “UOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKOU”, “DUKOIP”, “OUP”, “INP”, “OU” o “IN”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “DI”, “DIP”, “DO”, o “DOP”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

77. Precio de la barrera inferior dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “78. Modalidad del precio barrera dos” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “76. Precio de la Barrera Superior dos” y el valor de este campo es mayor que “0” (cero), entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al reportado en el campo 74.

Uso Público

Información de acceso público.

Si el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “DI”, “DIP”, “DO”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKOUN”, “DUKOIP”, “OUP”, “INP”, “OU” o “IN”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “78. Modalidad del Precio Barrera dos” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, o “UOP”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

78. Modalidad del precio barrera dos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo “Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO.

Si el valor de este campo es igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOUN”, “DUKOIP”, “OUP” o “INP”, entonces deberá el campo “84. Revisión de los ‘parámetros principales’” deberá ser igual a “S”.

79. Intervalo o frecuencia de monitoreo del o los precios barrera dos

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

Si el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a “N”, entonces este campo deberá ser igual a “0” (cero).

En caso de que este campo sea mayor que “0” (cero), entonces el valor numérico reportado debe ser menor al número de días naturales que resulten de restar al campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio, o Fecha Única de Ejercicio”), el campo 6 (“Fecha de Inicio de Período de Ejercicio”).

Si el campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOUN” o “DUKOIP”, entonces este campo debe ser mayor que “0” (cero).

80. Fecha de inicio de la ventana de la barrera dos

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, En caso de que el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” sea igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOUN”, “DUKOIP”, “OUP” o “INP”, el valor de este campo deberá ser diferente de vacío.

81. Fecha de término de la ventana de la barrera dos

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, En caso de que el valor del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” sea igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOUN”, “DUKOIP”, “OUP” o “INP” el valor de este campo deberá ser diferente de vacío.

82. Rebate

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 100.

Uso Público

Información de acceso público.

83. Callable

Este campo no podrá reportarse vacío, y el valor de este campo puede ser igual a “SA”, “SS” o “N”. Adicionalmente, si el valor de este campo es igual a la clave “SA”, entonces el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” o del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” deberá ser igual a alguna de las claves: “UO”, “DO”, “UOP”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOIP”, “OUP” o “OU”.

84. Revisión de los “parámetros principales”

Este campo no podrá reportarse vacío, y el valor de este campo puede ser igual a “S” o “N”.

Si el valor del campo “72. Modalidad del precio barrera” o del campo “78. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOIP”, “OUP” o “INP”, entonces este campo debe ser igual a “S”.

85. 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.

86. Socio liquidador de la operación

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.

87. 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 cuya columna “mercado” sea distinta de “TR”.

Asimismo, si el campo “86. Socio Liquidador de la Operación” es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual a “90”. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y En caso de que una operación no cumpla con lo anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar que la clave reportada corresponda a un Repositorio de Derivados”.

Adicionalmente, si el campo “86. Socio Liquidador de la Operación” es distinto de “077000”, entonces este campo debe ser distinto de “90”.

88. 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 cuya columna “mercado” sea igual a “TR”. Adicionalmente, podrá aceptar el valor “90”.

89. 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”.

Uso Público

Información de acceso público.

En caso de que el campo “87. Cámara de Compensación” 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”) cuando dicho campo (“Clave de la Contraparte”) sea de seis caracteres, o iii) a la clave “CveBMXC” proveniente del cruce del Código LEI de 20 caracteres, cuando se haya reportado éste en el campo 4 (“Clave de la Contraparte”), con el “Catálogo de Contrapartes”, a que se refiere el Anexo “B”, para obtener la clave “CveBMXC” correspondiente; o iv) la clave “000111”.

Si el campo “87. Cámara de Compensación” 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”.

90. Identificador único del producto

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el valor sea distinto de vacío, se deberá anotar un número para identificar a cada registro según el tipo de subyacente del que se trate la operación.

91. Valor del parámetro delta

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser numérico, es decir deberá aceptar tanto valores positivos como negativos.

92. Volatilidad implícita

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

93. Identificación del contrato anfitrión

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el valor sea distinto de vacío, la clave que se anote deberá estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”. Si utilizan la clave del CVT, dicha clave deberá estar comprendida en el catálogo correspondiente del CVT.

94. Número de identificación utilizado por la institución

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar un número para identificar a cada registro el cual podrá ser alfanumérico, que utilice la institución para identificar sus operaciones.

95. 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).

96. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

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

Complemento de la sección IX (paquetes de opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato).

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO.

Los registros enviados por cada institución en la sección IX, que en el campo 84 (Revisión de los Parámetros Principales) sean igual a "S", debe reportarse en esta sección de complemento. Asimismo, los registros que en la sección IX tengan el campo 84 igual a "N", NO deben reportarse en esta sección de complemento.

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.

Esta clave debe ser igual a la del campo 1 ("Clave de la Institución") de la Sección IX, 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 95).

2. Fecha de concertación

Este campo no podrá reportarse vacío y esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Adicionalmente, esta fecha es uno de los tres campos "llave" para relacionar los registros de este "Complemento" con los correspondientes de la sección IX.

3. Número de identificación de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este es uno de los tres campos "llave" para relacionar los registros de este "Complemento" con los correspondientes de la sección IX.

4. Número del periodo de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros, de forma tal que para una misma "Fecha de Concertación" (campo 2) y "Número de Identificación" (campo 3), dos o más registros no sean iguales en este campo.

5. Importe base aplicable al periodo de ejercicio

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

6. Fecha de inicio del periodo de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Esta fecha debe ser mayor o igual al campo 6 “Fecha de Inicio del Período de Ejercicio” del registro correspondiente a la sección IX utilizando los tres campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 5) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 95), para relacionar los registros de este “Complemento” con los correspondientes de la sección IX.

Adicionalmente, esta fecha debe ser mayor o igual que la fecha del campo 7 (“Fecha de Término del Período de Ejercicio”), en caso de que el “Número del Periodo de Ejercicio” (campo 4) del registro que se está validando sea el inmediato anterior del registro correspondiente. Por ejemplo, si el registro que se está validando es igual a “3” en el campo 4 (“Número del periodo de ejercicio”), entonces este campo debe ser mayor o igual a la “Fecha de Término del Periodo de Ejercicio” (campo 7) del registro cuyo campo 4 (“Número del periodo de ejercicio”) sea igual a “2”.

En caso de que el campo “13. Modalidad del ejercicio” sea igual a “E”, y el campo 45 (“La operación es parte de una operación estructurada o paquete”) sea igual a “90”, entonces la fecha registrada en este campo debe ser igual a la “Fecha de concertación” (campo 5). Si la fecha registrada en este campo es mayor a la “Fecha de concertación” (campo 5), se debe mostrar el diagnóstico de validación no grave: “(VTG-392) Favor de verificar la fecha de inicio del periodo de ejercicio, conforme al contenido de la hoja de términos y condiciones correspondiente”.

7. Fecha de término del periodo de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Adicionalmente esta fecha debe ser mayor que la del campo 6 (“Fecha de Inicio del Periodo de Ejercicio”).

La fecha reportada en este campo en su último registro debe ser igual al campo “7. Fecha de término del período de ejercicio, o fecha única de ejercicio” de la Sección IX, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

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).

9. Factor aplicado a la forma de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser siempre positivo. En caso de que su valor sea menor o igual a 10, SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: “Favor de confirmar el factor aplicado (en términos porcentuales) a la forma de liquidación reportada en el campo “31. Cálculo de liquidación” reportado en la Sección IX”.

10. Diferencial aplicado a la forma de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y el valor de este campo deberá contener alguno de los siguientes valores:

- a) Igual a “0”.
- b) Valores negativos, por ejemplo “-0.098”.

Uso Público

Información de acceso público.

c) Valores positivos, por ejemplo "0.098".

En caso de que su valor sea mayor o igual a 100, se debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación no grave: "Favor de confirmar el diferencial aplicado a la forma de liquidación reportada en el campo "31. Cálculo de liquidación" reportado en la Sección IX".

11. Memoria del pago

Este campo podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves "S" o "N".

12. Tipo de subyacente

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea no vacío, la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo Tipos de Subyacente" a que se refiere el Anexo F.

13. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío.

En caso de que la clave del campo 12 ("Tipo de Subyacente") corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a "TIC"), un índice accionario (sea igual a "IAM" o "IAX"), un título de deuda (sea igual a "TDM" o "TDE"), una tasa de interés variable (sea igual a "TIM" o "TIX"), un título representativo de capital (sea igual a "ACM" o "ACE"), o un título referenciado a acciones (sea igual a "TRM" o "TRE"), la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de "NA".

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 "12. Tipo de Subyacente". Por ejemplo, si el valor de este campo es igual a "USDMXN", que de acuerdo a la columna "clase_subyacente" del Anexo AF es igual a "Divisas", este valor debe ser igual al que corresponda a la columna "clase_suby" del Anexo F (igual a "Divisas" cuando el campo "12. Tipo de Subyacente" es igual a "TIC").

Si la clave del campo 12 ("Tipo de Subyacente") es distinta de un tipo de cambio (no es igual a "TIC"), un índice accionario (no es igual a "IAM" o "IAX"), un título de deuda (no es igual a "TDM" o "TDE"), una tasa de interés variable (no es igual a "TIM" o "TIX"), un título representativo de capital (no es igual a "ACM" o "ACE") o un título referenciado (no es igual a "TRM" o "TRE"), este campo deberá ser igual a "NA" (No aplica).

Si el campo 12 ("Tipo de Subyacente") está vacío, este campo debe ser igual a "NA".

14. Precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que "0" (cero) y menor que 400 mil.

15. Precio de la barrera superior

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “17. Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “17. Modalidad del precio barrera” es igual a la clave “UI”, “UO”, “DIKOU” o “DUKOI”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “17. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “DI” o “DO”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

16. Precio de la barrera inferior

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). Adicionalmente, si el campo 15 y el campo 16 es mayor a cero, entonces el valor reportado en este campo deberá ser menor al valor reportado en el campo 15.

En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo 17. “Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “17. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “UI” o “UO”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “17. Modalidad del precio barrera” es igual a la clave “DI”, “DO”, “DIKOU”, “DUKOI”, “IN” o “OU”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

17. Modalidad del precio barrera

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo “Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO y ser diferente de la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKoup”, “DUKOIP”, “OUP” y “INP”.

18. Fecha de inicio del período de la ventana de la barrera

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD.

19. Fecha de término del período de la ventana de la barrera

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD.

20. Precio unitario o tasa de ejercicio dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero) y menor que 400 mil.

21. Precio de la barrera superior dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo 23. “Modalidad del Precio Barrera dos” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Si el valor del campo “23. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “UI”, “UO”, “DIKOU”, “DUKOI”, “IN” o “OU”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “23. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “DI” o “DO”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

22. Precio de la barrera inferior dos

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). Adicionalmente, si el campo 21 y el campo 22 es mayor a cero, entonces el valor reportado en este campo deberá ser menor al valor reportado en el campo 21.

Si el valor del campo “23. Modalidad del Precio Barrera dos” es igual a la clave “UI” o “UO” entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo 23. “Modalidad del Precio Barrera dos” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “23. Modalidad del precio barrera dos” es igual a la clave “DI”, “DO”, “DIKOU”, “DUKOI”, “OU” o “IN”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

23. Modalidad del precio barrera dos

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo “Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO y ser diferente de la clave “UIP”, “DIP”, “UOP”, “DOP”, “DIKoup”, “DUKOIP”, “INP” y “OUP”.

24. Fecha de inicio del período de la ventana de la barrera dos

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD.

25. Fecha de término del período de la ventana de la barrera dos

Este campo podrá ser vacío. En caso de que sea diferente de vacío, se deberá anotar la fecha con formato AAAA/MM/DD.

26. Rebate

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 100.

27. Callable

Este campo no podrá reportarse vacío, y el valor de este campo puede ser igual a “SA”, “SS” o “N”.

28. Fecha de inicio del flujo a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, la fecha de anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario.

Uso Público

Información de acceso público.

29. Fecha de vencimiento del flujo a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de inicio del primer flujo a recibir o entregar (campo 28). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

30. Factor aplicable a la tasa de referencia a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, el valor de este campo deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3).

Asimismo, si el campo “32. Valor de la tasa fija a recibir o entregar” es distinto de cero, la clave que se anote en este campo debe ser igual a “0”.

31. Puntos porcentuales a aplicar a la tasa de referencia a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, el valor de este campo deberá contener algunos de los siguientes valores:

- a) Signo “-” (menos) y un valor numérico que deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3), por ejemplo “-.35”.
- b) Un valor numérico que deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3), por ejemplo “.35”.

32. Valor de la tasa fija a recibir o entregar

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que sea diferente de vacío, el valor numérico de este campo debe ser igual o mayor que cero y menor que quince (15). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso de que el valor reportado esté fuera del rango anterior debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar la tasa fija con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

33. 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.

34. Importe de la prima

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

35. 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 IX), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 3).

Uso Público

Información de acceso público.

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

Sección X.- Convalidación de opciones con estructuras de pagos realizados bajo un mismo contrato y celebradas en Mercados No Reconocidos.

B. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO.

Los registros que la institución reporte en esta sección X deben corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con los registros de la sección IX 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 IX enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de Concertación” (campo 2) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

2. Fecha de concertación

Este campo no podrá reportarse vacío y esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

3. 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, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de concertación de la operación (campo 2).

4. 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.

5. Número de identificación de la operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Concertación” (campo 2). Adicionalmente, este campo es uno de los tres campos “llave” para relacionar los registros de esta sección, con los correspondientes de la Sección IX 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. Posición de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío y aceptará únicamente el valor “A” o “D”.

8. Valor de la volatilidad implícita

Este campo podrá reportarse vacío En caso de que el campo 20 sea igual a “S”.
En caso de que su valor sea distinto de vacío su valor numérico debe ser mayor que cero.

9. Valor del parámetro delta

Este campo podrá reportarse vacío en caso de que el campo 20 sea igual a “S”.
En caso de que su valor sea distinto de vacío, éste podrá ser un valor positivo o negativo.

10. Moneda del parámetro delta

Este campo podrá reportarse vacío en caso de que el valor del parámetro delta (campo 9) sea distinto de vacío, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

11. Valor del parámetro gamma

Este campo podrá reportarse vacío en caso de que el campo 20 sea igual a “S”. En caso de que su valor sea distinto de vacío, este podrá ser un valor positivo o negativo.

12. Valor del parámetro vega

Este campo podrá reportarse vacío en caso de que el campo 20 sea igual a “S”. En caso de que su valor sea distinto de vacío, este podrá ser un valor positivo o negativo.

13. Valor del parámetro rho

Este campo podrá reportarse vacío en caso de que el campo 20 sea igual a “S”. En caso de que su valor sea distinto de vacío, este podrá ser un valor positivo o negativo.

14. Tasa de referencia para determinar la tasa rho de la operación

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o en el “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección. En caso de que el valor del campo 13 sea igual a vacío, el valor de este campo podrá ser igual o distinto a “NA”.

15. Valor del parámetro rho dos

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que su valor sea distinto de vacío éste podrá ser un valor positivo o negativo.

En caso de que el subyacente de la operación que corresponda de acuerdo con los campos llave de la operación sea distinto a una divisa, es decir, el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo F, que corresponda al subyacente reportado en el campo “49. Tipo de Subyacente” sea distinto a “Divisas”, entonces este campo deberá ser igual a vacío.

16. Tasa de referencia para determinar una segunda sensibilidad

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o en el “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección. En caso de que el valor del campo 15 sea igual a vacío, el valor de este campo podrá ser igual o distinto a “NA”.

17. Valor del parámetro rho tres

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que su valor sea distinto de vacío, podrá ser un valor positivo o negativo.

18. Tasa de referencia para determinar una tercera sensibilidad

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF o en el “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección. En caso de que el valor del campo 17 sea igual a vacío, el valor de este campo podrá ser igual o distinto a “NA”.

19. Precio del subyacente

Este campo podrá ser igual a vacío. En caso de que alguno de los valores de los campos 8, 9, 11, 12, 13, 15 o 17 sea distinto de vacío, entonces este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser numérico y positivo.

20. Complemento de curvas de sensibilidad

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor podrá ser únicamente “S” o “N”. En caso de que alguno de los campos 8, 9, 11, 12 o 13, haya sido reportado con valor igual a vacío o los campos 13, 15 y 17 sean vacío y al mismo tiempo los campos 14, 16 y 18 sean distintos a “NA”, el valor de este campo deberá ser igual a “S”. Por otro lado, en caso de que los campos 8, 9, 11, 12 y 13, hayan sido reportados distintos a vacío o los campos 13, 15 y 17 sean vacío y al mismo tiempo los campos 14, 16 y 18 sean distintos a “NA”, el valor de este campo deberá ser igual a “N”.

21. Curva o superficie de referencia de sensibilidad

Para el caso de opciones distintas sobre canastas de subyacentes, este campo podrá reportarse vacío únicamente en caso de que el valor del campo 9 haya sido reportado distinto de vacío. En caso de que este campo sea distinto de vacío, el valor de este campo deberá ser

Uso Público

Información de acceso público.

reportado previamente en el campo 7 (“Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio) en algún registro de la Sección XII referente a “Sensibilidades”, de acuerdo con los campos “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y Número de identificación de la operación (campo 5).

En el caso de opciones sobre canastas, el valor de este campo y el valor del campo 9 podrán ser vacíos y deberá reportarse la Sección XII referente a “Sensibilidades”. Es decir, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los registros reportados en la Sección IX con el objetivo de obtener el valor de la “Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” (campo 50 de la sección IX); si la clase de subyacente de dicho campo (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) corresponde a “Canasta Títulos deuda ext”, “Canasta Títulos deuda mexicano”, “Canasta Títulos Ref Extranjero”, “Canasta Acciones” o “Canasta Indices”, entonces el registro se refiere a una opción sobre canastas. Consecuentemente, deberá existir al menos un registro, de acuerdo con los mismos campos llave, en la Sección XII referente a “Sensibilidades” y uno de estos registros en el campo “factor de riesgo” (campo 6 de la Sección XII) deberá ser igual a “1”.

En caso de operaciones sobre canastas de subyacentes, si el valor del campo 9 (Valor del parámetro delta) es distinto vacío, entonces el valor de este campo debe ser igual a vacío, o si el valor del campo 9 (Valor del parámetro delta) es igual a vacío, entonces el valor de este campo debe ser distinto a vacío.

En caso de que el campo 20 haya sido reportado con valor igual a “N”, el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

Si este campo se reporta distinto de vacío, dicho valor deberá de encontrarse en el anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección.

22. Curva o superficie de referencia de sensibilidad dos

Para el caso de opciones distintas sobre canastas de subyacentes, este campo podrá reportarse vacío únicamente en caso de que el valor del campo 11 haya sido reportado distinto vacío. En caso de que este campo sea distinto de vacío, el valor de este campo deberá ser reportado previamente en el campo 7 (“Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio) en algún registro de la Sección XII referente a “Sensibilidades”, de acuerdo con los campos llave “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y Número de identificación de la operación (campo 5).

En el caso de opciones sobre canastas, el valor de este campo y el valor del campo 11 podrán ser vacío y deberá reportarse en la Sección XII referente a “Sensibilidades”. Es decir, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los registros reportados en la Sección IX con el objeto de obtener el valor de la “Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” (campo 50 de la sección IX); si la clase de subyacente de dicho campo (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) corresponde a “Canasta Títulos deuda ext”, “Canasta Títulos deuda mexicano”, “Canasta Títulos Ref Extranjero”, “Canasta Acciones”

Uso Público

Información de acceso público.

o “Canasta Indices”, entonces el registro se refiere a una opción sobre canastas. Consecuentemente, el valor de este campo puede ser vacío.

En caso de operaciones sobre canastas de subyacentes, si el valor del campo 11 (Valor del parámetro gamma) es distinto vacío, entonces el valor de este campo debe ser igual a vacío o si el valor del campo 11 (Valor del parámetro gamma) es igual a vacío, entonces el valor de este campo debe ser distinto a vacío.

En caso de que el campo 20 haya sido reportado con valor igual a “N”, el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

Si este campo se reporta distinto de vacío, dicho valor deberá de encontrarse en el anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección.

23. Curva o superficie de referencia de sensibilidad tres

Para el caso de opciones distintas sobre canastas de subyacentes, este campo podrá reportarse vacío únicamente en caso de que el valor del campo 12 haya sido reportado distinto vacío. En caso de que este campo sea distinto de vacío, el valor de este campo deberá ser reportado previamente en el campo 7 (“Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio) en algún registro de la Sección XII referente a “Sensibilidades”, de acuerdo con los campos llave “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y Número de identificación de la operación (campo 5).

En el caso de opciones sobre canastas, el valor de este campo y el valor del campo 12 podrán ser vacío y deberá reportarse en la Sección XII referente a “Sensibilidades”. Es decir, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los registros reportados en la Sección IX con el objetivo de obtener el valor de la “Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” (campo 50 de la sección IX); si la clase de subyacente de dicho campo (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) corresponde a “Canasta Títulos deuda ext”, “Canasta Títulos deuda mexicano”, “Canasta Títulos Ref Extranjero”, “Canasta Acciones” o “Canasta Indices”, entonces el registro se refiere a una opción sobre canastas. Consecuentemente, el valor de este campo puede ser vacío.

En caso de operaciones distintas a canastas de subyacentes, si el valor del campo 12 (Valor del parámetro vega) es igual al vacío, entonces el valor de este campo (Curva o superficie de referencia de sensibilidad tres) debe distinto a vacío, o si el valor del campo 12 (Valor del parámetro vega) es distinto al vacío, entonces el valor de este campo (Curva o superficie de referencia de sensibilidad tres) debe igual a vacío.

En caso de que el campo 20 haya sido reportado con valor igual a “N”, el valor de este campo deberá ser igual a vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Si este campo se reporta distinto de vacío, dicho valor deberá de encontrarse en el anexo AT, para ello deberá filtrarse el catálogo AT considerando sólo los registros de la institución indicada en el campo 1 de esta sección.

24. La operación es parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser igual a: “0” (cero) o “1” (uno).

Este campo puede ser igual a “1”, si el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) de la operación vigente a convalidar, conforme a los campos “llave”, es igual a “TIM” o “TIX”. Es decir, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los registros reportados en la Sección IX y obtener el valor del campo 49 y este deberá ser igual a “TIM” o “TIX”.

Si para la operación vigente a convalidar (conforme a los campos “llave”), el campo 49 (“Tipo de Subyacente”) es distinto de “TIM” o “TIX”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero). Es decir, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los registros reportados en la Sección IX y obtener el valor del campo 49 y este no deberá ser igual a “TIM” ni a “TIX”.

25. Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que forman parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que el campo 24 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “1”, este campo debe ser distinto de “NA”.

En caso de que el campo 24 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “0” (cero), este campo debe ser igual a “NA”.

26. Número consecutivo para identificar a la operación que forma parte de un “paquete”

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma “Fecha de Corte” (campo 3), y “Clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de un mismo Paquete” (campo 21).

En caso de que el campo 24 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea distinto a “0” y el campo 25 (“Clave o Folio con el que se identifica al Conjunto de Operaciones que forman un Paquete”) sea el mismo para más de una operación, el valor numérico debe iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros.

En caso de que el campo 24 (“La Operación es parte de un Paquete”) sea igual a “0” (cero), y, por tanto, el campo 25 (“Clave o Folio con el que se identifica al Conjunto de Operaciones que forman un Paquete”) sea igual a “NA”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

27. Importe actualizado (mercado) de la prima (total)

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor deberá ser numérico, y podrá ser un valor positivo o negativo.

Uso Público

Información de acceso público.

28. Clave o folio para identificar los activos que constituyen la garantía de la operación

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, Sección IX) de los registros que corresponden a las operaciones vigentes enviados a convalidar a través del SAIF-Web deberá estar incluida en el campo 3 de alguno de los registros de la Sección IV del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

29. 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 IX del formulario OPTO, de acuerdo a los campos llave: institución, fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 5).

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

Secciones XI.- Información sobre las “Canastas” subyacentes en opciones celebradas en Mercados No Reconocidos.

1. Clave de la canasta

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, deberá comenzar con la cadena “CIA” En caso de no ser vacío, la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

2. 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.

3. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”.

4. Número consecutivo para identificar al subyacente que forma parte de la canasta

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Este campo no podrá reportarse vacío. 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 de canasta (campo 1) y misma clave de institución (campo 2). Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros que tengan la misma clave de canasta (campo 1) y misma clave de institución (campo 2).

5. Tipo de monitoreo

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe aceptar únicamente las claves "WO", "BE" o "TO".

6. Ponderador

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, el valor de este número deberá ser mayor a cero y menor a 100.

7. Precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser distinto a vacío, su valor numérico deberá ser igual o mayor que "0" (cero) y menor que 400 mil.

8. Forma en la que está representado el precio de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Tipo de precio" a que se refiere el Anexo AM.

Si el campo "7. Precio unitario o tasa de ejercicio" es igual a "0" (cero), entonces el valor de este campo debe ser igual a la clave "1". Adicionalmente, si el campo "7. Precio unitario o tasa de ejercicio" es mayor a "0" (cero) y la clave del campo 3, corresponda a alguna de las siguientes subyacentes del catálogo "AF" (en el campo " suby"): "IAM", "IAX" o "I99", entonces el valor de este campo debe ser igual a la clave "3" o "4".

9. Moneda del precio unitario o tasa de ejercicio

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave de "Moneda" que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" a que se refiere el Anexo E (y ser distinta de la clave "0"). En caso de que el valor del campo "7. Precio unitario o tasa de ejercicio" sea igual a cero, entonces el valor de este campo deberá ser igual a "0" (cero).

10. Precio inicial del subyacente

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser numérico y positivo.

11. Cálculo aplicable al precio del subyacente para determinar el ejercicio de la opción

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Ejercicio" a que se refiere el Anexo AN.

12. Cálculo de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Cálculo de liquidación" a que se refiere el Anexo AK.

13. Factor aplicado a la forma de liquidación

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser siempre positivo. En caso de que su valor sea menor o igual a 10, SAIF-Web debe mostrar el siguiente diagnóstico de validación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

no grave: “Favor de confirmar el factor aplicado (en términos porcentuales) a la forma de liquidación reportada en el campo “12. Cálculo de liquidación””.

14. Precio de la barrera superior

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “16. Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “16. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, “UOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKoup” o “DUKOIP”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

15. Precio de la barrera inferior

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor numérico debe ser igual o mayor que “0” (cero). En el caso de operaciones que no tengan precios barrera (campo “16. Modalidad del Precio Barrera” igual a “N”), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el valor del campo “14. Precio de la Barrera Superior” y el valor de este campo es mayor que “0” (cero), entonces el valor reportado en este campo debe ser menor al reportado en el campo 14.

Si el valor del campo “16. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “DI”, “DIP”, “DO”, “DOP”, “DIKOU”, “DUKOI”, “DIKoup” o “DUKOIP”, “OU” o “IN”, el valor de este campo deberá ser mayor a “0” (cero).

Si el valor del campo “16. Modalidad del Precio Barrera” es igual a la clave “UI”, “UIP”, “UO”, o “UOP”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

16. Modalidad del precio barrera

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el Catálogo “Tipos de barrera” a que se refiere el Anexo AO.

17. Intervalo o frecuencia de monitoreo del o los precios barrera

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico debe ser mayor o igual que “0” (cero) y menor o igual que 365.

Secciones XII.- Información sobre Curvas de Sensibilidad y factores de riesgo en opciones celebradas en mercados no reconocidos

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. Fecha de concertación

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a alguna de las claves 1 a 5, el valor de este campo deberá ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero). Asimismo, esta fecha es uno de los campos “llave” para relacionar

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

los registros de esta Sección con los correspondientes de la Sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, y su valor debe ser igual a la del campo 2 (“Fecha de concertación”) de la Sección X, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea distinta de las claves 1 a 5, el valor de este campo deberá ser vacío.

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) a reportar se refiera a una curva o superficie (clave 6 a 8), el valor de este campo podrá ser igual a vacío.

3. Fecha de corte

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso de que 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 reportar que se trate.

Adicionalmente, en caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a alguna de las claves 1 a 5, esta fecha debe corresponder a uno de los cuatro campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección con los correspondientes de la sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, y su valor debe ser igual a la del campo 3 (“Fecha de corte”) de la Sección X, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea distinto de las claves 1 a 5, debe existir al menos un registro en la sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, que cumpla con la combinación de campos: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de corte” (campo 3), y campo 7 “Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”, que corresponda a los campos de la Sección X: “Clave de la institución” (campo 1), campo 3 (“Fecha de corte”), y alguno de los campos “Curva o superficie de referencia de sensibilidad” (campo 21), “Curva o superficie de referencia de sensibilidad dos” (campo 22) o “Curva o superficie de referencia de sensibilidad” (campo 23).

Por otro lado, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de concertación de la operación (campo 2).

4. Número de identificación de la operación

Este campo podrá reportarse vacío. Si el campo 2, “Fecha de concertación”, es vacío, este campo deberá ser vacío.

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a alguna de las claves 1 a 5, este número debe corresponder a uno de los cuatro campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección con los correspondientes de la Sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, y su valor debe ser igual a la del campo 5 (“Número de Identificación de la Operación”) de la Sección X, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

Uso Público

Información de acceso público.

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea distinta de las claves 1 a 5, el valor de este campo deberá ser vacío.

Si este campo es distinto de vacío y si el valor del campo 50 ("Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo De Cambio") al realizar el cruce con la Sección IX usando los campos llaves "Clave de la institución" (campo 1), "Fecha de concertación" (campo 2) y "Número de Identificación de la Operación" (campo 95) corresponde a una canasta de subyacentes, deberán existir tantos registros en esta sección con los mismos campos primarios "Clave de la institución" (campo 1), "Fecha de concertación" (campo 2), "Fecha de corte" (campo 3), "Número de Identificación de la Operación" (campo 4) y "Nombre del factor de riesgo" (campo 6) como subyacentes en la canasta. Para identificar si se trata de una canasta, el valor del campo 50 ("Clave del Valor, Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo De Cambio") al cruzarlo con el catálogo "AF", deberá comenzar con la cadena "CIA". Cabe mencionar que, el número de subyacentes fue previamente reportado en la Sección XI.

5. Número consecutivo para identificar registros que forman parte del factor de riesgo

Este campo no podrá reportarse vacío.

En caso de opciones con subyacentes distintos de canastas, si el campo 2, "Fecha de concertación", es distinto del vacío, entonces el valor numérico reportado no podrá ser el mismo para dos o más registros individuales, además deberá iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) siempre y cuando tengan la misma "Clave de la institución" (campo 1), misma "Fecha de concertación" (campo 2), misma "Fecha de Corte" (campo 3), mismo "Número de Identificación de la Operación" (campo 4), mismo "Factor de riesgo" (campo 6) y misma "Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio" (campo 7).

En caso de opciones sobre canastas, si el campo 2, "Fecha de concertación", es distinto del vacío, entonces el valor numérico reportado no podrá ser el mismo para dos o más registros individuales, además deberá iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) siempre y cuando que tengan la misma "Clave de la institución" (campo 1), misma "Fecha de concertación" (campo 2), misma "Fecha de Corte" (campo 3), mismo "Número de Identificación de la Operación" (campo 4) y mismo "Factor de riesgo" (campo 6).

Si el campo 2, "Fecha de concertación", es distinto del vacío, entonces el valor numérico reportado no podrá ser el mismo para dos o más registros individuales, además deberá iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) siempre y cuando tengan la misma "Clave de la institución" (campo 1), misma "Fecha de concertación" (campo 2), misma "Fecha de Corte" (campo 3), mismo "Número de Identificación de la Operación" (campo 4), mismo "Factor de riesgo" (campo 6) y misma "Clave del valor, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio" (campo 7).

6. Nombre del factor de riesgo

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se registre debe estar comprendida en el "Catálogo de Factor de Riesgo" a que se refiere el Anexo AR.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)

Las siguientes validaciones aplican para las operaciones que tengan los mismos campos “llave” en la Sección X; es decir, la misma “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de Corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los reportados en la Sección X referente a la “Convalidación de opciones vigentes”:

- a) En caso el valor del campo 9 de la sección X haya sido reportado con valor igual a vacío, entonces el valor de este campo para un registro con los campos llaves de esta sección: Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4) deberá ser igual a “1”
- b) En caso el valor del campo 11 de la sección X haya sido reportado con valor igual a vacío, entonces el valor de este campo para un registro con los campos llaves de esta sección: Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4) deberá ser igual a “2”
- c) En caso el valor del campo 12 de la sección X haya sido reportado con valor igual a vacío, entonces el valor de este campo para un registro con los campos llaves de esta sección: Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4) deberá ser igual a “3”
- d) En caso el valor del campo 13 de la sección X haya sido reportado con valor igual a vacío, entonces el valor de este campo para un registro con los campos llaves de esta sección: Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4) deberá ser igual a “4”.

En caso de que el valor del campo 8 de la sección X haya sido reportado vacío, entonces el valor del campo “6. Nombre del factor de riesgo”, de la sección XII, utilizando los siguientes campos “llave” de la sección XII: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de corte” (campo 3), y “Clave del valor ‘deuda o acción’, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio (campo 7)” con los siguientes campos “llave” de la Sección X: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de corte” (campo 3), y “Curva o superficie de referencia de sensibilidad tres” (campo 23), para al menos un registro, deberá ser igual a “8”.

Adicionalmente, en caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a las claves 1 a 5, debe existir al menos un registro en la sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, que cumpla con la combinación de campos: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 4), que corresponda a los campos de la Sección X: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), “Fecha de corte” (campo 3) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

Finalmente, en caso de que el factor de riesgo (campo 6) sea distinto de las claves 1 a 5, debe existir al menos un registro en la sección X, referente a la “Convalidación de opciones vigentes”, que cumpla con la combinación de campos: “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de corte” (campo 3), y campo 7 “Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio”, que corresponda a los campos de la Sección X: “Clave de la institución” (campo 1), campo 3 (“Fecha de corte”), y alguno de los campos “Curva o superficie de referencia de sensibilidad” (campo 21), “Curva o superficie de referencia de sensibilidad dos” (campo 22) o “Curva o superficie de referencia de sensibilidad” (campo 23).

Uso Público

Información de acceso público.

7. Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio

Este campo no podrá reportarse vacío. En el caso de opciones sobre canastas, la clave de este campo debe estar comprendida 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, y ser distinta de “NA”. Para saber si se refiere a una opción sobre canastas, se deberá mapear la “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5) con los reportados en la Sección IX para obtener el valor de la “Clave del valor (deuda o acción), índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio” (campo 50 de la sección IX); si la clase de subyacente de dicho campo (columna “clase_subyacente” del Anexo AF) corresponde a “Canasta Títulos deuda ext”, “Canasta Títulos deuda mexicano”, “Canasta Títulos Ref Extranjero”, “Canasta Acciones” o “Canasta Indices”, entonces el registro se refiere a una opción sobre canastas.

Asimismo, en caso de opciones sobre canastas, el valor reportado en este campo en combinación con su número consecutivo (campo 5) deberá ser igual al valor reportado en el campo 3 en combinación con el campo 4 (ambos de la Sección XI), de acuerdo a la clave de canasta asignada (campo 1 de la Sección XI) reportada en el campo 50 de la Sección IX en su fecha de concertación, utilizando para ello los campos llave “Clave de la institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 2), y “Número de Identificación de la Operación” (campo 5).

En caso de que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves “6” a “8”), se deberá anotar la “clave” que corresponda a la curva o superficie, conforme al “Catálogo de Curvas o Superficies” a que se refiere el Anexo AT.

8. Fecha del nodo de la curva

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), el valor de este campo no podrá ser vacío y la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD.

9. Plazo del nodo la curva

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), el valor de este campo no podrá ser vacío y su valor deberá ser igual o mayor a 0. En caso de que el valor del campo 10 sea distinto de la clave “ON”, el valor de este campo deberá ser igual o mayor a 1.

10. Temporalidad del plazo

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) se refiera a una curva o superficie (claves 6 a 8), el valor de este campo no podrá ser vacío, y la clave que se registre debe estar comprendida en el “Catálogo de Temporalidad del plazo” a que se refiere el Anexo AS.

11. Valor de la griega o sensibilidad

Uso Público

Información de acceso público.

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) sea distinto a una curva o superficie (claves 6 a 8), el valor de este campo no podrá ser vacío y su valor deberá ser numérico.

12. Moneda del valor de la griega o sensibilidad

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el valor de la griega o sensibilidad sea distinto de vacío (campo 11), la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E y ser distinta de cero.

En caso de que el valor del campo 11 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

13. Valor asociado al factor de riesgo

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) sea distinto a una de las claves 1 a 5, el valor de este campo deberá ser distinto de vacío y su valor deberá ser numérico.

14. Moneda del valor de la griega o sensibilidad

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el valor asociado al factor de riesgo (campo 13) sea distinto de vacío, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E y ser distinta de cero.

En caso de que el valor del campo 13 sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

15. Valor dos asociado al factor de riesgo

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a la clave 8, el valor de este campo deberá ser distinto de vacío y su valor deberá ser numérico.

16. Moneda del valor dos asociado al factor de riesgo

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el valor dos asociado al factor de riesgo (campo 15) sea distinto de vacío, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E y ser distinta de cero. En el caso que el valor dos asociado al factor de riesgo (campo 15) sea vacío, el valor de este campo deberá ser reportado vacío.

17. Precio del subyacente utilizado para el factor de riesgo

Este campo podrá reportarse vacío. En el caso que el factor de riesgo (campo 6) sea igual a la clave 8, el valor de este campo deberá ser distinto de vacío.

18. Número consecutivo para identificar registros que forman parte del mismo envío

Este campo no podrá reportarse vacío. El valor numérico reportado debe iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros. Adicionalmente, este número no podrá ser el mismo para dos o más registros individuales que tengan la misma “Clave de la institución” (campo 1) y misma “Fecha de Corte” (campo 3).

Uso Público

Información de acceso público.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a opciones y títulos opcionales (Warrants), para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (OPTO)



BANCO DE MÉXICO

www.banxico.org.mx