

FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA (PRÉSTAMOS), DE LAS INSTITUCIONES DE CRÉDITO Y CASAS DE BOLSA.

AYUDAS GENÉRICAS

I. FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN.

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".

Circular 3/2012, Capítulo VII, artículo 108

Informes a la Dirección de Información del Sistema Financiero.

"Las Instituciones deberán proporcionar a la Dirección General de Asuntos del Sistema Financiero, a la Dirección General de Operaciones de Banca Central, a la Dirección General de Estrategia, Riesgos y Sistemas de Pagos, así como a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México, la información que, en el ámbito de su competencia, dichas unidades administrativas les requieran.

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

Circular 115/2002 numeral CB.8

"Información al Banco de México.

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

II. OBJETO DEL REQUERIMIENTO.

Este formulario tiene como objetivo principal obtener la información necesaria para determinar diversos indicadores relativos a las operaciones de préstamo de títulos de deuda; así como para dar seguimiento a la regulación aplicable y realizar diversos análisis.

La información reportada en este formulario, junto con la información relativa a las operaciones de reporto y de compra-venta (a las que se refieren los formularios REPORTOS y CVT, respectivamente), se utiliza para determinar la posición de riesgo de las instituciones, así como para calcular la tenencia de títulos, tanto la que es propiedad de la Institución, como aquella propiedad de sus clientes.

III. COBERTURA DEL FORMULARIO

Deben informarse todas las operaciones por cuenta propia que realice: i) la Institución, incluyendo las operaciones de sus oficinas en la República Mexicana como, en su caso, de sus Agencias y Sucursales en el Exterior, y ii) las Entidades Financieras del Exterior Filiales de la propia Institución (Entidad Financiera Filial).

La información de cada Entidad Financiera del Exterior Filial debe transmitirse, en su caso, en archivos separados (un archivo por cada entidad de que se trate), utilizando la clave que corresponda a la entidad conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al sistema de acopio.

IV. CONTENIDO DEL FORMULARIO.

El formulario está compuesto por dos secciones, en las que deberán reportarse, respectivamente, siguiente información:

1.- Préstamos de Títulos de Deuda denominados en Moneda Nacional o en Udis.

En esta sección deben reportarse todos los préstamos, realizados por cuenta propia, de títulos de deuda denominados en moneda nacional o en UDIS, emitidos por gobiernos, bancos, empresas, etc., ya sea en México o en el extranjero.

2.- Préstamos de Títulos de Deuda denominados en Moneda Extranjera.

En esta sección deben reportarse todos los préstamos, realizados por cuenta propia, de títulos de deuda denominados en moneda extranjera, emitidos por gobiernos, bancos, empresas, etc., ya sea en México o en el extranjero.

V. CIFRAS A REPORTAR.

La Institución deberá enviar un registro por cada operación de préstamo realizada (incluyendo aquellas con importe menor a mil pesos), no agrupando operaciones, aun cuando coincidan las características de las mismas. Se deberán transmitir las operaciones de préstamo de títulos de deuda celebradas con Banco de México, al amparo de la figura operativa de Formador de Mercado. Adicionalmente, las operaciones celebradas internamente entre áreas, por ejemplo, entre la Tesorería y la Mesa de Dinero de una misma Institución, no deben ser informadas, ya que estas operaciones no modifican la posición de riesgo ni la tenencia de títulos de la Institución.

En este formulario se solicita diversa información respecto de las características de las operaciones de préstamo, ello con independencia que tales operaciones se apeguen o no a las disposiciones aplicables.

Las preguntas que se hacen sobre ciertas características de las operaciones, las diversas instrucciones de llenado del formulario, los anexos al mismo, etc., por ningún motivo 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.

VI. DETERMINACIÓN DE LA FORMA EN QUE SE ACTUALIZARÁ LA BASE DE DATOS (RESIDENTE EN 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 para todas las secciones del formulario).

Baja: Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para eliminar de la base registros por operaciones improcedentes de envíos anteriores. (Esta opción aplica para todas las secciones 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 para todas las secciones del formulario).

VII. ACLARACIONES DIVERSAS

Operaciones con el “Fondo de Pensiones o Jubilaciones del Personal”

Con independencia de las cuentas contables en las que se tengan registradas las inversiones relativas al “Fondo de Pensiones o Jubilaciones del Personal de la Institución”, los préstamos celebrados entre la Institución y dicho Fondo de Pensiones, deberán identificarlos anotando en el campo de “Contraparte de la operación” la clave 000780, relativa a “Fondos de reserva para pensiones, jubilaciones y demás prestaciones del personal de la propia Institución”.

VIII. METODOLOGÍAS DE CONFRONTAS

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

A continuación se muestra una imagen para mayor referencia.



IX. FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN.

Este formulario es de periodicidad diaria. Las operaciones realizadas por la Institución deberán transmitirse al Banco de México, a más tardar a las 9:00 A.M. del día hábil bancario inmediato siguiente al día a que corresponda la información.

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

Cuando, por cualquier causa, la información no sea transmitida en "tiempo y forma" o se realicen retransmisiones de información, la Institución deberá manifestar a este Instituto Central las causas que originaron tal situación, y precisar, en el segundo caso, las modificaciones a las cifras, mediante comunicación por escrito que dirijan a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México.

XI. ACTUALIZACIÓN DE CATÁLOGOS.

En caso de que en los Catálogos de Títulos o Contrapartes no exista una clave para identificar algún elemento, las Instituciones podrán solicitar al Banco de México la inclusión de acuerdo a lo siguiente:

- **Títulos.** Deberán ser solicitados mediante un correo electrónico a las direcciones cvtreportos@banxico.org.mx o titulos@banxico.org.mx indicando la clave faltante y de ser posible incluyendo el prospecto o carta de características.
- **Contrapartes.** Deberá ser solicitada a través del formulario de Contrapartes (CGC).

ESTRUCTURAS DE LOS CAMPOS DE CADA SECCIÓN

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN "1" DEL FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA (PRÉSTAMOS): TÍTULOS DENOMINADOS EN M.N. O UDIS.

	Campo	Tipo	Descripción
1	Institución	Carácter (6)	Clave (CASFIM) de la institución a la cual corresponde la información
2	Fecha de Concertación de la Operación	Fecha	Fecha en que se concertó la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación de la Operación	Numérico (5,2)	Hora en que se concertó la operación de préstamo.
4	Posición en la Operación	Numérico (2)	Posición de la Institución en el préstamo (Prestamista = 50, Prestatario = 55).
5	Fecha de Inicio de la Operación	Fecha	Fecha en que inicia la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento de la Operación	Fecha	Fecha de vencimiento de la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Premio de la Operación	Numérico (12)	Importe del premio en el préstamo (expresado en pesos o en dólares de los E.U.A.)
8	Moneda del Importe del Premio	Carácter (3)	Moneda del premio pactado en el préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Monedas").
9	Importe del Castigo por Vencimiento Anticipado	Numérico (12)	Importe del castigo por cancelación anticipada del préstamo (expresado en pesos o en dólares de los E.U.A.)
10	Moneda del Importe del Castigo	Carácter (3)	Moneda del castigo pactado en el préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Monedas").
11	Tipo de Garantía de la Operación	Numérico (2)	Tipo de garantía del préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Garantías").
12	Aforo para la Garantía en la Operación	Numérico (5,2)	Aforo pactado para la garantía en el préstamo (Enteros y hasta dos decimales).
13	Clave del Título Objeto del Préstamo	Carácter (18)	Clave del título objeto de la operación de Préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Títulos de Deuda en M.N. o UDIS").
14	Número de Títulos Objeto de la Operación	Numérico (12)	Número de títulos negociados en el préstamo.
15	Contraparte de la Operación	Carácter (6)	Contraparte con la que se concertó la operación de préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Contrapartes").
16	Sistema de Negociación de la Operación	Numérico (2)	Sistema de Negociación con el cual se concertó el préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Sistemas de Negociación").
17	Oficina que realizó la Operación	Carácter (2)	Oficina que concertó el préstamo (Clave conforme al "Catálogo de Tipo de Oficina").
18	Número de identificación de la Operación.	Carácter (37)	Número de Identificación del préstamo
19	Número de Títulos No Transferidos, en la Fecha de Inicio	Numérico (12)	Número de títulos no transferidos en la fecha de inicio pactada en el préstamo.

ESTRUCTURA DE LA SECCIÓN “2” DEL FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA (PRÉSTAMOS): TÍTULOS DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.

	Campo	Tipo	Descripción
1	Institución	Carácter (6)	Clave (CASFIM) de la institución a la cual corresponde la información
2	Fecha de Concertación de la Operación	Fecha	Fecha en que se concertó la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
3	Hora de Concertación de la Operación	Numérico (5,2)	Hora en que se concertó la operación de préstamo.
4	Posición en la Operación	Numérico (2)	Posición de la Institución en el préstamo (Prestamista = 50, Prestatario = 55).
5	Fecha de Inicio de la Operación	Fecha	Fecha en que inicia la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
6	Fecha de Vencimiento de la Operación	Fecha	Fecha de vencimiento de la operación de préstamo (Formato AAAA/MM/DD).
7	Importe del Premio de la Operación	Numérico (12)	Importe del premio en el préstamo (Expresado en pesos o en dólares de los E.U.A.)
8	Moneda del Importe del Premio	Carácter (3)	Moneda del premio pactado en el préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Monedas”).
9	Importe del Castigo por Vencimiento Anticipado	Numérico (12)	Importe del castigo por cancelación anticipada del préstamo (Expresado en pesos o en dólares de los E.U.A.)
10	Moneda del Importe del Castigo	Carácter (3)	Moneda del castigo pactado en el préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Monedas”).
11	Tipo de Garantía de la Operación	Numérico (2)	Tipo de garantía del préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Garantías”).
12	Aforo para la Garantía en la Operación	Numérico (5,2)	Aforo pactado para la garantía en el préstamo (Enteros y hasta dos decimales).
13	Clave del Título Objeto del Préstamo	Carácter (18)	Clave del título objeto de la operación de Préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Títulos en Moneda Extranjera”).
14	Número de Títulos Objeto de la Operación	Numérico (12)	Número de títulos negociados en el préstamo.
15	Contraparte de la Operación	Carácter (6)	Contraparte con la que se concertó la operación de préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Contrapartes”).
16	Sistema de Negociación de la Operación	Numérico (2)	Sistema de Negociación con el cual se concertó el préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Sistemas de Negociación”).
17	Oficina que realizó la Operación	Carácter (2)	Oficina que concertó el préstamo (Clave conforme al “Catálogo de Tipo de Oficina”).
18	Número de identificación de la Operación.	Carácter (37)	Número de Identificación del préstamo
19	Número de Títulos No Transferidos, en la Fecha de Inicio	Numérico (12)	Número de títulos no transferidos en la fecha de inicio pactada en el préstamo.

AYUDAS ESPECÍFICAS PARA LOS CAMPOS DE CADA SECCIÓN

AYUDAS ESPECÍFICAS Y VALIDACIONES PARA LA SECCIÓN "1" DEL FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA (PRÉSTAMOS): TÍTULOS DE DEUDA DENOMINADOS EN M.N. O UDIS.

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

1. INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar el 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, conforme al "Catálogo de Instituciones" incorporado al SAIF-Web.

2. FECHA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de concertación del préstamo, independientemente, de la fecha "valor" (o fecha de inicio) del mismo.

Las operaciones concertadas con fecha valor se deben informar en el reporte relativo al de la fecha de tal concertación.

3. HORA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la hora en que se concertó el préstamo, registrando la hora y los minutos (en formato de 24 Horas.). Por ejemplo: las 10 de la mañana con 20 minutos = 10.20, las 3 de la tarde con 30 minutos = 15.30, etc.

4. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN.

En este campo se debe anotar:

- | | |
|----|---|
| 50 | Quando la Institución actúe como prestamista en la operación. |
| 55 | Quando la Institución actúe como prestataria en la operación. |

5. FECHA DE INICIO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de inicio del préstamo de que se trate, independientemente de su fecha de concertación (campo 2).

6. FECHA DE VENCIMIENTO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de vencimiento del préstamo de que se trate.

7. IMPORTE DEL PREMIO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el importe del premio pactado en la operación, expresado en: i) pesos mexicanos (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en UDIS, ó ii) dólares de los E.U.A. (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en otras divisas extranjeras. En el caso de operaciones en las que el premio se concertó en divisas distintas al dólar de los E.U.A., deberá convertirse dicho premio a dólares de los EE.UU.A., aplicando un tipo de cambio representativo de mercado para la fecha de concertación de que se trate (campo 2).

8. MONEDA DEL IMPORTE DEL PREMIO.

Se debe anotar la clave relativa a la moneda del "importe del premio de la operación (campo 7)", conforme al respectivo "Catálogo de Monedas" incorporado al SAIF-Web.

9. IMPORTE DEL CASTIGO POR VENCIMIENTO ANTICIPADO.

Se debe anotar, en su caso, el importe pactado del castigo por vencimiento anticipado de la operación, expresado en: i) pesos mexicanos (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en UDIS, ó ii) dólares de los E.U.A. (en unidades sin

decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en otras divisas extranjeras. En el caso de operaciones en las que el premio se concertó en divisas distintas al dólar de los E.U.A., deberá convertirse dicho premio a dólares de los EE.UU.A., aplicando un tipo de cambio representativo de mercado para la fecha de concertación de que se trate (campo 2).

En caso que la operación de que se trate no se tenga pactado castigo por vencimiento anticipado, se debe anotar un "0" (cero).

10. MONEDA DEL IMPORTE DEL CASTIGO.

Se debe anotar la clave relativa a la moneda del "importe del castigo por vencimiento anticipado (campo 9)", conforme al respectivo "Catálogo de Monedas" incorporado al SAIF-Web.

11. TIPO DE GARANTÍA DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave del tipo de garantía relativa al préstamo de que se trate, conforme al "Catálogo de Garantías" incorporado al SAIF-Web.

12. AFORO DE LA GARANTÍA EN LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el número de veces en que la garantía correspondiente debe (conforme al contrato) cubrir al valor de los títulos objeto del préstamo de que se trate ("aforo"), expresado en unidades y hasta dos decimales (por ejemplo, en caso que la garantía sea el 115% del valor de mercado de los títulos objeto de la operación, entonces se debe anotar 1.15).

13. CLAVE DEL TÍTULO OBJETO DEL PRÉSTAMO.

Se debe anotar la clave del título objeto del préstamo de que se trate, conforme al "Catálogo de Títulos de Deuda en M.N. o UDIS" incorporado al SAIF-Web.

14. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el número de títulos objeto del préstamo de que se trate, en unidades sin decimales.

15. CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave asignada a la contraparte de la operación de que se trate, conforme al "Catálogo de Contrapartes" incorporado al SAIF-Web.

Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito (incluyendo la "Financiera Rural"), ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) sociedades de inversión, v) instituciones de seguros, vi) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, vii) Sociedades Financieras de Objeto Múltiple, Entidades Reguladas, viii) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas y ix) entidades financieras del exterior; deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

Todas las operaciones con Contrapartes distintas a las entidades referidas en el párrafo anterior, deben identificarse con la clave genérica que les corresponda, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

16. SISTEMA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave del "Sistema de Negociación" por medio del cual se concertó la operación de que se trate, conforme al "Catálogo de Sistemas de Negociación" incorporado al SAIF-Web.

Tratándose de operaciones concertadas sin utilizar algún "Sistema de Negociación", en este campo se deberá anotar la clave "80" (No Aplica).

17. OFICINA QUE REALIZÓ LA OPERACIÓN.

Se debe indicar si la operación de que se trate fue celebrada por: i) Las oficinas en la República Mexicana de la Institución (clave "RM"), ii) las agencias y/o sucursales en el extranjero de dicha Institución (clave "AG"), o iii) alguna Entidad Financiera del Exterior Filial de dicha Institución (clave "EF").

18. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar un número para identificar a cada operación en particular, 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 2).

19. NÚMERO DE TÍTULOS NO TRANSFERIDOS, EN LA FECHA DE INICIO.

Este campo debe reportarse vacío en aquellas operaciones en las que el total del número de títulos objeto del préstamo fueron efectivamente transferidos y liquidados en la fecha pactado de inicio del préstamo de que se trate. Por lo tanto, sólo deberá utilizarse en aquellas operaciones en las que el número de títulos negociados (el total o algunos de ellos) no se transfirieron en la fecha originalmente pactada, en cuyo caso deberá informarse, el número de títulos no transferidos, en unidades sin decimales.

Tratándose de operaciones mismo día, la cifra de este campo deberá informarse el propio día de la concertación, conjuntamente con las demás características de la propia operación.

En el caso de operaciones fecha-valor 24, 48, 72 y 96 horas, en las que en la fecha de inicio no se transfirieran la totalidad de los títulos negociados, deberá darse de baja el registro originalmente transmitido y dar de alta un nuevo registro. En el registro de alta, además de los datos de los campos 1 al 19 deberá informarse la cifra de este campo. Tanto el registro de baja como el nuevo registro de alta, deberán informarse en la fecha de inicio de la operación de que se trate.

**AYUDAS ESPECÍFICAS Y VALIDACIONES PARA LA SECCIÓN “2” DEL FORMULARIO
RELATIVO A LAS OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE TÍTULOS DE DEUDA (PRÉSTAMOS):
TÍTULOS DE DEUDA DENOMINADOS EN MONEDA EXTRANJERA.**

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

1. INSTITUCIÓN.

Se deberá anotar el 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, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF-Web.

2. FECHA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de concertación del préstamo, independientemente, de la fecha "valor" (o fecha de inicio) del mismo.

Las operaciones concertadas con fecha valor se deben informar en el reporte relativo al de la fecha de tal concertación.

3. HORA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la hora en que se concertó el préstamo, registrando la hora y los minutos (en formato de 24 Horas.). Por ejemplo: las 10 de la mañana con 20 minutos = 10.20, las 3 de la tarde con 30 minutos = 15.30, etc.

4. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN.

En este campo se debe anotar:

- | | |
|----|---|
| 50 | Quando la Institución actúe como prestamista en la operación. |
| 55 | Quando la Institución actúe como prestataria en la operación. |

5. FECHA DE INICIO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de inicio del préstamo de que se trate, independientemente de su fecha de concertación (campo 2).

6. FECHA DE VENCIMIENTO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la fecha de vencimiento del préstamo de que se trate.

7. IMPORTE DEL PREMIO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el importe del premio pactado en la operación, expresado en: i) pesos mexicanos (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en UDIS, o ii) dólares de los E.U.A. (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en otras divisas extranjeras. En el caso de operaciones en las que el premio se concertó en divisas distintas al dólar de los E.U.A., deberá convertirse dicho premio a dólares de los EE.UU.A., aplicando un tipo de cambio representativo de mercado para la fecha de concertación de que se trate (campo 2).

8. MONEDA DEL IMPORTE DEL PREMIO.

Se debe anotar la clave relativa a la moneda del “importe del premio de la operación (campo 7)”, conforme al respectivo “Catálogo de Monedas” incorporado al SAIF-Web.

9. IMPORTE DEL CASTIGO POR VENCIMIENTO ANTICIPADO.

Se debe anotar, en su caso, el importe pactado del castigo por vencimiento anticipado de la operación, expresado en: i) pesos mexicanos (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en UDIS, o ii) dólares de los E.U.A. (en unidades sin decimales), en el caso de operaciones cuyo premio se pactó en dicha moneda o en otras divisas extranjeras. En el caso de operaciones en las que el premio se concertó en divisas distintas al dólar

de los E.U.A., deberá convertirse dicho premio a dólares de los EE.UU.A., aplicando un tipo de cambio representativo de mercado para la fecha de concertación de que se trate (campo 2).

En caso que la operación de que se trate no se tenga pactado castigo por vencimiento anticipado, se debe anotar un "0" (cero).

10. MONEDA DEL IMPORTE DEL CASTIGO.

Se debe anotar la clave relativa a la moneda del "importe del castigo por vencimiento anticipado (campo 8)", conforme al respectivo "Catálogo de Monedas" incorporado al SAIF-Web.

11. TIPO DE GARANTÍA DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave del tipo de garantía relativa al préstamo de que se trate, conforme al "Catálogo de Garantías" incorporado al SAIF-Web.

12. AFORO DE LA GARANTÍA EN LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el número de veces en que la garantía correspondiente debe (conforme al contrato) cubrir al valor de los títulos objeto del préstamo de que se trate ("aforo"), expresado en unidades y hasta dos decimales (Por ejemplo, en caso que la garantía sea el 115% del valor de mercado de los títulos objeto de la operación, entonces se debe anotar 1.15).

13. CLAVE DEL TÍTULO OBJETO DEL PRÉSTAMO.

Se debe indicar la clave ISIN o CUSIP del título objeto de la operación de que se trate, conforme al "Catálogo de Títulos de Deuda en Moneda Extranjera" incorporado al SAIF-Web.

14. NÚMERO DE TÍTULOS OBJETO DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar el número de títulos objeto del préstamo de que se trate, en unidades sin decimales.

15. CONTRAPARTE DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave asignada a la contraparte de la operación de que se trate, conforme al "Catálogo de Contrapartes" incorporado al SAIF-Web.

Todas las operaciones cuyas contrapartes sean: i) instituciones de crédito (incluyendo la "Financiera Rural"), ii) casas de bolsa, iii) subsidiarias financieras en el exterior de las instituciones anteriores, iv) sociedades de inversión, v) instituciones de seguros, vi) sociedades de inversión especializadas en fondos para el retiro, vii) Sociedades Financieras de Objeto Múltiple, Entidades Reguladas, viii) Instituciones de Tecnología Financiera (ITF) y FINTECH no reguladas y ix) entidades financieras del exterior; deberán identificarse con la clave particular de tales sociedades e instituciones, según el citado "Catálogo de Contrapartes".

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

16. SISTEMA DE CONCERTACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar la clave del "Sistema de Negociación" por medio del cual se concertó la operación de que se trate, conforme al "Catálogo de Sistemas de Negociación" incorporado al SAIF-Web.

Tratándose de operaciones concertadas sin utilizar algún "Sistema de Negociación", en este campo se deberá anotar la clave "80" (No Aplica).

17. OFICINA QUE REALIZÓ LA OPERACIÓN.

Se debe indicar si la operación de que se trate fue celebrada por: i) las oficinas en la República Mexicana de la Institución (clave "RM"), ii) las agencias y/o sucursales en el extranjero de dicha Institución (clave "AG"), o iii) alguna Entidad Financiera del Exterior Filial de dicha Institución (clave "EF").

18. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN.

Se debe anotar un número para identificar a cada operación en particular, 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 2).

19. NÚMERO DE TÍTULOS NO TRANSFERIDOS, EN LA FECHA DE INICIO.

Este campo debe reportarse vacío en aquellas operaciones en las que el total del número de títulos objeto del préstamo fueron efectivamente transferidos y liquidados en la fecha de inicio del préstamo de que se trate. Por lo tanto, sólo deberá utilizarse en aquellas operaciones en las que el número de títulos negociados (el total o un subconjunto) no se transfirieron en la fecha originalmente pactada, en cuyo caso deberá informarse, el número de títulos no transferidos, en unidades sin decimales.

Tratándose de operaciones mismo día, la cifra de este campo deberá informarse el propio día de la concertación, conjuntamente con las demás características de la propia operación.

En el caso de operaciones fecha-valor 24, 48, 72 y 96 horas, en las que en la fecha de inicio no se transfirieran la totalidad de los títulos negociados, deberá darse de baja el registro originalmente transmitido y dar de alta un nuevo registro. En el registro de alta, además de los datos de los campos 1 al 19 deberá informarse la cifra de este campo. Tanto el registro de baja como el nuevo registro de alta, deberán informarse en la fecha de inicio de la operación de que se trate.

VALIDACIONES REALIZADAS POR EL SISTEMA DE ACOPIO

1. Institución.

Este campo no podrá reportarse vacío.

La clave que se anote en este campo deberá corresponder a la asignada a la Institución para estos propósitos, conforme al "Catálogo de Instituciones" incorporado SAIF-Web.

2. Fecha de Concertación de la Operación (Con Formato AAAA/MM/DD).

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser menor o igual a la fecha de inicio del préstamo (campo 5).

3. Hora de Concertación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío ni en "0" (cero).

4. Posición en la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío y la clave deberá estar comprendida en el "Catálogo de Posición en la Operación" incorporado SAIF-Web.

5. Fecha de Inicio de la Operación (con Formato AAAA/MM/DD).

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser mayor o igual a la fecha de concertación (campo 2), pero menor a la fecha de vencimiento (campo 6).

6. Fecha de Vencimiento de la Operación (con Formato AAAA/MM/DD).

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá ser mayor a la fecha de inicio (campo 5).

7. Importe del Premio de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío ni en "0" (cero).

8. Moneda del Importe del Premio.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" incorporado SAIF-Web.

9. Importe del Castigo por vencimiento anticipado.

Este campo debe ser igual o mayor que "0" (cero).

10. Moneda del Importe del Castigo.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el "Catálogo de Monedas" incorporado al "SAIF-Web". En caso que el importe del castigo (campo 9) sea igual a cero, entonces este campo deberá ser igual a "NAP" (No Aplica).

11. Tipo de Garantía de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el "Catálogo de Garantías" incorporado SAIF-Web.

12. Aforo de la Garantía en la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser mayor que cero.

13. Clave del Título Objeto del Préstamo.

Este campo no podrá reportarse vacío.

El sistema diagnosticará los casos en que la clave del título no esté comprendida en el "Catálogo de Títulos de Deuda en Moneda Extranjera".

14. Número de Títulos Objeto de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío, ni en "0" (cero).

15. Contraparte de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. El número que se registre no podrá ser el de la propia Institución, y deberá estar comprendido en el "Catálogo de Contrapartes" incorporado SAIF-Web.

16. Sistema de Concertación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones en las que no se utilice un "Sistema de Negociación" para su concertación, se deberá anotar "80" (No aplica). La clave que, en su caso, se registre deberá estar comprendida en el "Catálogo de Sistemas de Negociación" incorporado SAIF-Web.

17. Oficina que realizó la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote en este campo deberá estar comprendida en el "Catálogo de Tipo de Oficina" incorporado SAIF-Web.

18. Número de Identificación de la Operación.

Este campo no podrá reportarse vacío.

19. Número de Títulos no Transferidos, en la Fecha de Inicio

Este campo deberá reportarse vacío en aquellas operaciones en las que la fecha de inicio del préstamo (campo 5) sea mayor (o posterior) a la fecha de envío de la información respectiva a Banco de México.

El número de títulos registrado en este campo no podrá ser mayor al número de títulos objeto del préstamo (campo 14).