



BANCO DE MÉXICO

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos (“SWAPS”), para las Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y Sofomes ER (SWAPS) Ayudas



CONTENIDO

Ayudas generales	4
I. Fundamento legal del requerimiento de información	4
II. Objetivo del requerimiento	6
III. Definiciones	6
IV. Cobertura del formulario	7
V. Contenido del formulario.....	7
VI. Determinación de la forma en que se actualizará la base de datos (residente en Banco de México)	8
VII. Operaciones que no deben incluirse en este formulario.....	9
VI. Metodologías de confrontas.....	9
VIII. Fecha y horario de entrega de la información	10
IX. Actualización de catálogos o anexos	10
X. Estructura del formulario por sección	10
Ayudas específicas para cada campo del formulario	23
Sección I.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados reconocidos.....	23
Sección II.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con un importe base de referencia (“Interest Rate Swaps”)	25
Sección II Complemento (“Interest Rate SWAPS”).....	38
Sección III.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos, sobre tasas de interés y con dos importes base de referencia (“Cross Currency Swaps”).....	43
Sección III Complemento (“CROSS CURRENCY SWAPS”)	55
Sección IV.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre subyacentes distintos a tasas de interés	60
Sección IV Complemento (Swaps sobre subyacentes distintos a tasas de interés)	76
Sección V.- Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos, de operaciones celebradas en mercados tanto reconocidos como no reconocidos	80

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección VI.- Intercambios de importe base, o pago o recepción de cuota compensatoria, para las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	86
Sección VII.- Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebrada en mercados reconocidos	88
Sección VIII.- Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.....	91
Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario.....	95
Sección I.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados reconocidos.....	95
Sección II.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con un importe base de referencia (“Interest Rate Swaps”)	98
Complemento de la Sección II (“Interest Rate Swaps”)	107
Sección III.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos, sobre tasas de interés y con dos importes base de referencia (“Cross Currency Swaps”).....	113
Complemento de la Sección III (“Cross Currency Swaps”)	122
Sección IV.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre subyacentes distintos a tasas de interés	129
Complemento de la Sección IV (Swaps sobre subyacentes distintos a tasas de interés)	138
Sección V.- Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos, de operaciones celebradas en mercados tanto reconocidos como no reconocidos	145
Sección VI.- Intercambios de importe base, o pago o recepción de cuota compensatoria, para las operaciones celebradas en mercados no reconocidos.....	150
Sección VII.- Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebrada en mercados reconocidos	154
Sección VIII, Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebradas en mercados no reconocidos.....	157

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Ayudas generales

I. Fundamento legal del requerimiento de información

Ley de Instituciones de Crédito, Artículo 97

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

Ley del Banco de México, Artículo 36

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

Reglamento Interior del Banco de México, Artículo 25 Bis, fracción

I

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

Circular 3/2012 del Banco de México, Artículo 108

Información al Banco de México.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Circular 4/2012 del Banco de México

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.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 Swaps, medición de la exposición al riesgo de dichas operaciones por parte de la Entidad, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.

III. Definiciones

Para efectos de este formulario se entenderá como:

- Operaciones, a los Contratos de Intercambio de Flujos o “Swaps”.
- Día hábil, Divisas, Fecha de liquidación, Liquidación, Mercados reconocidos, y Subyacentes, a lo señalado en la Circular 4/2012 del Banco de México.
- Operaciones en mercados no reconocidos, a las operaciones celebradas en mercados distintos a los reconocidos, incluyendo los mercados extrabursátiles (OTC: “Over the Counter”).
- 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. Un caso particular de “operación estructurada” es un Título Bancario Estructurado, el cual consiste en un título de deuda que tiene una serie de intercambios de flujos de dinero implícitos (“Swap”).
- Paquetes de derivados (negociados tanto en mercados reconocidos como OTC), a la contratación simultánea de operaciones derivadas, que pueden o no ser de la misma naturaleza, al amparo de una sola transacción. Un caso particular de “paquetes de derivados” es el “Swaption”, el cual consiste en una opción cuyo subyacente es un “swap”. Otro caso particular es un Derivado de Rendimiento Total (“Total Return Swap”), el cual consiste en un contrato de intercambio de flujos o “swap” que tiene implícito un derivado de incumplimiento crediticio (“Credit Default Swap”).
- Parámetros principales de operaciones en mercados no reconocidos, al importe base de referencia, el intervalo de revisión de la tasa de interés, el intervalo de pago de cada flujo, la tasa de interés de referencia o el subyacente, y los factores y puntos aplicables a la tasa de interés de referencia, relativos a un determinado contrato de intercambio de flujos o “swap”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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, Casa de Bolsa o Sociedad Financiera de Objeto Múltiple Reguladas 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 deberá elaborar un reporte por cada una las Entidades Financieras Filiales de la Institución en el exterior.

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

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.

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.

V. Contenido del formulario

El formulario deberá contener las operaciones de “Swap”, una a una, desde su fecha de concertación, incluyendo las que deriven del ejercicio de opciones sobre swaps (“*Swaptions*”), y aquellas implícitas en notas, títulos u Operaciones Estructuradas. Al efecto, la institución no deberá realizar proceso de consolidación alguno. El formulario está compuesto por las ocho secciones siguientes:

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

Sección II. Comprende las operaciones en **mercados no reconocidos** sobre **tasas de interés con un importe base de referencia (“*Interest Rate Swaps*”)**.

Sección III. Comprende las operaciones en **mercados no reconocidos** sobre **tasas de interés con dos importes base de referencia (“*Cross Currency Swaps*”)**.

Sección IV. Comprende las operaciones en **mercados no reconocidos** sobre **subyacentes distintos a tasas de interés**.

Sección V. Para informar el **vencimiento anticipado**, o **cesión de derechos**, de operaciones que fueron previamente enviadas en las secciones I, II, III o IV.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección VI Para informar el detalle de los **intercambios de importe base**, para operaciones reportadas en las secciones III o IV.

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

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

En principio, cada contrato de intercambio de flujos o “swap” debe enviarse como un solo registro, en la sección que corresponda (de acuerdo a sus características). Sin embargo, en el caso de contratos 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 flujos, en el “Complemento” de la sección que corresponda, detallando cada uno de los flujos 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, III o IV, según corresponda. Adicionalmente, en la misma fecha deberá reportarse un vencimiento total, “VT” en la Sección V de la operación a la que se le haya efectuado dicha transición, usando la clave “7” en el campo 14 “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, e indicar el número de identificación del nuevo registro en el campo 17 “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 (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 exclusivamente para las secciones I, II, III, IV, V y VI (incluyendo, en su caso, sus complementos respectivos) del formulario.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 y V 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 VI (incluyendo, en su caso, sus complementos respectivos) del formulario.

VII. Operaciones que no deben incluirse en este formulario

En este formulario no deberán incluirse, entre otras, aquéllas operaciones que pretendan “replicar” un swap; tales como:

- Los futuros sobre tasas de interés negociados en el Mercado Mexicano de Derivados (MexDer), conocidos como “engrapados”, así como aquéllos negociados en el “*Chicago Mercantile Exchange*” conocidos como “*strips*”, “*packs*”, “*bundles*” o “*blocks*”.
- Las operaciones a futuro de compra-venta o de intercambio de un subyacente por un precio predeterminado, con un solo flujo a recibir y a entregar (Por ejemplo, un “*Commodity Swap*”).
- Otras operaciones en mercados no reconocidos que “repliquen” la “estructura de pagos” de un “*Swap*”, pero cuyo contrato especifique una operación de naturaleza diferente a éste; por ejemplo, la contratación de forwards sucesivos sobre tasas de interés. Los futuros y forwards arriba mencionados se deberán reportar en el formulario “OFF”.

Asimismo, en este formulario, no deberán incluirse los “*Credit Default Swaps*” o “Derivados de Incumplimiento Crediticio”.

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:



Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

VIII. Fecha y horario de entrega de la información

Las Secciones I, II, III, IV y VI (incluyendo, en su caso, sus complementos respectivos) 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 V).

La Sección V de este formulario deberá enviarse en la misma fecha del evento de vencimiento anticipado o de cesión de derechos de que se trate (por tanto, todos los registros deben tener la misma fecha de vencimiento anticipado), antes de las 17:30 Horas (utilizando la opción de “Bloque” a que se refiere la Ayuda General V).

En caso que la institución se percate que uno o más registros no fueron enviados en su fecha de concertación o vencimiento (o de cesión de derechos), o que fueron enviados por error, o que alguna característica requiere ser modificada o cambiada, debe enviar los registros de alta, baja y/o de cambio que correspondan (ya sea en la Sección I, II, III, IV o V), utilizando las opciones “Alta”, “Baja” o “Cambios”, respectivamente, a que se refiere la Ayuda General V.

Por su parte, las Secciones VII y VIII 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 V).

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.

IX. Actualización de catálogos o anexos

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

X. 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

o Anexos que son de largo fijo), mientras que el segundo, al número máximo de posiciones decimales.

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

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARACTER	1
3	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
4	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
5	MERCADO	MERCADO	ANEXO S	CARACTER	3
6	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
7	POS_OPER	POSICIÓN EN LA OPERACIÓN		CARACTER	1
8	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
9	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARACTER	2
10	NUMCONTRAT	NÚMERO DE CONTRATOS		NUMÉRICO	(6,0)
11	TAS_FIJ_RE	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
12	TAS_FIJ_EN	VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
13	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
14	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
15	OPER_DER	OPERADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO P	CARACTER	6
16	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
17	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20

Estructura de la Sección II: Operaciones celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con un importe base de referencia ("Interest Rate swaps")

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INSTI	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FE1_FLU_RE	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FEN_FLU_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE1_FLU_EN	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	FEN_FLU_EN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

9	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	NUMÉRICO	(2,0)
10	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
11	REV_SWAP	REVISIÓN DE LOS "PARÁMETROS" DEL "SWAP"	ANEXO H	CARÁCTER	5
12	DET_FLUJO	ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS	ANEXO I	CARACTER	2
13	IMP_BASE	IMPORTE BASE DEL CONTRATO		NUMÉRICO	(15,0)
14	MDA_IMP	MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL IMPORTE BASE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
15	LIQ_FLU	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO.		NUMÉRICO	(2,0)
16	NU_FLU_RE	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
17	NU_FLU_EN	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
18	INT_FLU_RE	INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
19	INT_FLU_EN	INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
20	TIP_TAS_RE	TIPO DE TASA A RECIBIR	ANEXO F	CARACTER	3
21	TAS_FIJ_RE	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
22	TAS_REF_RE	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
23	REV_TREF_RE	INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
24	ANIO_RE	AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (RECIBIR)		CARÁCTER	1
25	FE_REF_RE	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR	ANEXO V	CARÁCTER	3
26	FA1_TAS_RE	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NUMÉRICO	(8,6)
27	OP1_TAS_RE	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		CARÁCTER	1
28	PT1_TAS_RE	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
29	TIP_TAS_EN	TIPO DE TASA A ENTREGAR	ANEXO F	CARACTER	3
30	TAS_FIJ_EN	VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
31	TAS_REF_EN	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL VALOR DE LA TASA VARIABLE A ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
32	REV_TREF_EN	INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
33	ANIO_EN	AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (ENTREGAR)		CARÁCTER	1
34	FE_REF_EN	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3
35	FA1_TAS_EN	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(8,6)
36	OP1_TAS_EN	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		CARÁCTER	1
37	PT1_TAS_EN	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
38	CUO_COMP	ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA ("UP FRONT FEE")	ANEXO X	CARÁCTER	1
39	VEN_ANT	VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		CARACTER	1
40	TER_OPE	TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
41	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE".	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

42	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
43	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
44	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
45	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
46	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
47	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
48	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
49	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
50	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	34
51	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
52	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura del complemento de la Sección II ("Interest Rate Swaps")

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	IMP_BASE	IMPORTE BASE DEL FLUJO		NUMÉRICO	(15,0)
6	NU_FL_RE	NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
7	FEIN_FL_RE	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	FEIN_VE_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
9	TIP_TAS_RE	TIPO DE TASA A RECIBIR	ANEXO F	CARACTER	3
10	TAS_FIJ_RE	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
11	TAS_REF_RE	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
12	OP1_TAS_RE	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		CARÁCTER	1
13	PT1_TAS_RE	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
14	FE_REF_RE	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR	ANEXO V	CARÁCTER	3
15	NU_FL_EN	NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
16	FE_IN_FLRE	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
17	FE_VE_FLEN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
18	TIP_TAS_EN	TIPO DE TASA A ENTREGAR	ANEXO F	CARACTER	3
19	TAS_FIJ_EN	VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
20	TAS_REF_EN	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

21	OP1_TAS_EN	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		CARÁCTER	1
22	PT1_TAS_EN	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
23	FE_REF_EN	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3
24	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
25	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección III: Operaciones celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con dos importes base de referencia (Cross Currency Swaps)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INSTI	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FE1_FLU_RE	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FEN_FLU_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE1_FLU_EN	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	FEN_FLU_EN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
9	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	NUMÉRICO	(2,0)
10	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
11	REV_SWAP	REVISIÓN DE LOS "PARÁMETROS" DE LA OPERACIÓN	ANEXO H	CARÁCTER	5
12	DET_FLUJO	ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS	ANEXO I	CARÁCTER	2
13	INTERC_IMP	MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE	ANEXO Q	CARÁCTER	1
14	IMP_BA_RE	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
15	MDA_IMP_RE	MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
16	IMP_BA_EN	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
17	MDA_IMP_EN	MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
18	LIQ_FLU	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO.		NUMÉRICO	(2,0)
19	NU_FLU_RE	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
20	NU_FLU_EN	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
21	INT_FLU_RE	INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
22	INT_FLU_EN	INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
23	TIP_TAS_RE	TIPO DE TASA A RECIBIR	ANEXO F	CARACTER	3
24	TAS_FU_RE	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
25	TAS_REF_RE	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL VALOR DE LA TASA VARIABLE A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
26	REV_TREF_RE	INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE		NUMÉRICO	(3,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

		REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR			
27	ANIO_RE	AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A RECIBIR)		CARÁCTER	1
28	FE_REF_RE	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR	ANEXO V	CARÁCTER	3
29	FA1_TAS_RE	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NUMÉRICO	(8,6)
30	OP1_TAS_RE	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		CARÁCTER	1
31	PT1_TAS_RE	PUNTOS PORCENTUALES A APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NÚMÉRICO	(9,6)
32	TIP_TAS_EN	TIPO DE TASA A ENTREGAR	ANEXO F	CARACTER	3
33	TAS_FIJ_EN	VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
34	TAS_REF_EN	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL VALOR DE LA TASA VARIABLE A ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
35	REV_TREF_EN	INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
36	ANIO_EN	AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A ENTREGAR)		CARÁCTER	1
37	FE_REF_EN	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3
38	FA1_TAS_EN	FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NÚMÉRICO	(8,6)
39	OP1_TAS_EN	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		CARÁCTER	1
40	PT1_TAS_EN	PUNTOS PORCENTUALES A APLICAR A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
41	CUO_COMP	ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA ("UP FRONT FEE")	ANEXO X	CARÁCTER	1
42	VEN_ANT	VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		CARACTER	1
43	TER_OPE	TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
44	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE".	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
45	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
46	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
47	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
48	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
49	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
50	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
51	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
52	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
53	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	34
54	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
55	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Estructura del complemento de la Sección III (Cross Currency Swaps)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/D D
4	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
5	NU_FL_RE	NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
6	IMP_BA_RE	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
7	FEIN_FL_RE	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/D D
8	FEIN_VE_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/D D
9	TIP_TAS_RE	TIPO DE TASA A RECIBIR	ANEXO F	CARACTER	3
10	TAS_FIJ_RE	VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
11	TAS_REF_RE	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
12	OP1_TAS_RE	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		CARÁCTER	1
13	PT1_TAS_RE	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,6)
14	FE_REF_RE	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR	ANEXO V	CARÁCTER	3
15	NU_FL_EN	NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
16	IMP_BA_EN	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
17	FEIN_FL_EN	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/D D
18	FEIN_VE_EN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/D D
19	TIP_TAS_EN	TIPO DE TASA A ENTREGAR	ANEXO F	CARACTER	3
20	TAS_FIJ_EN	VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
21	TAS_REF_EN	TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
22	OP1_TAS_EN	OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		CARÁCTER	1
23	PT1_TAS_EN	PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,6)
24	FE_REF_EN	MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3
25	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
26	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección IV: Operaciones celebradas en mercados no reconocidos sobre subyacentes distintos a tasas de interés

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INSTI	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	OFICINA	OFICINA QUE REALIZA LA OPERACIÓN	ANEXO A	CARÁCTER	1
3	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

4	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	FE1_FLU_RE	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
6	FEN_FLU_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE1_FLU_EN	FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	FEN_FLU_EN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
9	TIP_DER	TIPO DE PRODUCTO DERIVADO	ANEXO C	NUMÉRICO	(2,0)
10	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
11	REV_SWAP	REVISIÓN DE LOS "PARÁMETROS" DEL "SWAP"	ANEXO H	CARÁCTER	5
12	DET_FLUJO	ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS	ANEXO I	CARÁCTER	2
13	INTERC_IMP	MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE	ANEXO Q	CARÁCTER	1
14	IMP_BA_RE	IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
15	MDA_IMP_RE	MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
16	IMP_BA_EN	IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
17	MDA_IMP_EN	MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
18	LIQ_FLU	NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO		NUMÉRICO	(2,0)
19	NU_FLU_RE	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
20	NU_FLU_EN	NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP		NUMÉRICO	(3,0)
21	INT_FLU_RE	INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
22	INT_FLU_EN	INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
23	TIP_LIQ	TIPO DE LIQUIDACIÓN		CARÁCTER	1
24	MDA_LIQ	MONEDA DE LIQUIDACIÓN	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
25	SUBY_RE	SUBYACENTE A RECIBIR	ANEXO F	CARÁCTER	3
26	CVE_TIT_RE	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO, A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
27	NU_SUBY_RE	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,0)
28	CUANT_RE	FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR		CARÁCTER	1
29	PRE_SUB_RE	PRECIO A ENTREGAR, POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR		NUMÉRICO	(13,6)
30	MDA_PRE_EN	MONEDA DEL PRECIO A ENTREGAR	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
31	FE_EN_RE	MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR	ANEXO V	CARÁCTER	3
32	SUBY_EN	SUBYACENTE A ENTREGAR	ANEXO F	CARÁCTER	3
33	CVE_TIT_EN	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO, A ENTREGAR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
34	NU_SUBY_EN	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,0)
35	CUANT_EN	FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR		CARÁCTER	1
36	PRE_SUB_EN	PRECIO A RECIBIR, POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR		NUMÉRICO	(13,6)
37	MDA_PRE_RE	MONEDA DEL PRECIO A RECIBIR	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
38	FE_RE_EN	MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR	ANEXO V	CARÁCTER	3

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

39	CUO_COMP	ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA ("UP FRONT FEE")	ANEXO X	CARÁCTER	1
40	VEN_ANT	VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		CARACTER	1
41	TER_OPE	TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
42	PAQ_EST	LA OPERACIÓN ES PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE".	ANEXO J	NUMÉRICO	(2,0)
43	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
44	CON_PAQ_EST	NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UNA "OPERACIÓN ESTRUCTURADA" O "PAQUETE"		NUMÉRICO	(3,0)
45	BROKER	PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN	ANEXO K	NUMÉRICO	(2,0)
46	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN	ANEXO O	CARACTER	6
47	CAM_COM	CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS	ANEXO L	NUMÉRICO	(2,0)
48	AG_CAL	AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN	ANEXO B	CARACTER	6
49	NUM_CONF	CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
50	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
51	NUM_ID_OP_SBY	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE		ALFANUMÉRICO	34
52	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
53	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura del complemento de la Sección IV (Swaps sobre subyacentes distintos a tasas de interés)

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	CONT	CLAVE DE LA CONTRAPARTE	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
3	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
4	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
5	NU_FL_RE	NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR		NUMÉRICO	(3,0)
6	IMP_BA_RE	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
7	FEIN_FL_RE	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	FEIN_VE_RE	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
9	SUBY_RE	SUBYACENTE A RECIBIR	ANEXO F	CARÁCTER	3
10	CVE_TIT_RE	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE CAMBIO, A RECIBIR	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20
11	NU_SUBY_RE	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A RECIBIR		NUMÉRICO	(9,0)
12	CUANT_RE	FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR		CARÁCTER	1
13	PRE_SUB_RE	PRECIO A ENTREGAR, POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR		NUMÉRICO	(13,6)
14	NU_FL_EN	NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR		NUMÉRICO	(3,0)
15	IMP_BA_EN	IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
16	FEIN_FL_EN	FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
17	FEIN_VE_EN	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
18	SUBY_EN	SUBYACENTE A ENTREGAR	ANEXO F	CARÁCTER	3
19	CVE_TIT_EN	CLAVE DEL VALOR (DEUDA O ACCIÓN), ÍNDICE ACCIONARIO, TASA DE INTERÉS O TIPO DE	ANEXO AF	ALFANUMÉRICO	20

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

		CAMBIO, A ENTREGAR			
20	NU_SUBY_EN	NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A ENTREGAR		NUMÉRICO	(9,0)
21	CUANT_EN	FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR		CARÁCTER	1
22	PRE_SUB_EN	PRECIO A RECIBIR, POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR		NUMÉRICO	(13,6)
23	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
24	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Estructura de la Sección V: Información de vencimientos anticipados, o cesiones de derechos, de operaciones celebradas tanto en mercados reconocidos como no reconocidos

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	PRO_TER	ORIGEN DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
3	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
4	FECHA	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
5	SEC_SWAP	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(1,0)
6	FECVEN_A	FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FECLIQ_A	FECHA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA		FECHA	AAAA/MM/DD
8	IMP_VEN	IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		NUMÉRICO	(15,0)
9	MDA_VEN	MONEDA DEL IMPORTE POR VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
10	VTOT_IMPE	IMPORTE ENTREGADO POR VENCIMIENTO ANTICIPADO TOTAL		NUMÉRICO	(15,0)
11	VPAR_IMPR	IMPORTE A RECIBIR QUE VENCE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL		NUMÉRICO	(15,0)
12	VPAR_IMPE	IMPORTE A ENTREGAR QUE VENCE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL		NUMÉRICO	(15,0)
13	PAG_VENA	LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		CARÁCTER	1
14	MOT_VENA	MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS	ANEXO R	NUMÉRICO	(1,0)
15	VEN_ANT	INDICADOR DE VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS		CARACTER	2
16	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN (ORIGINAL)		ALFANUMÉRICO	34
17	NUM_ID_CP	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA NUEVA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
18	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
19	UTI_O	UTI ORIGINAL		ALFANUMÉRICO	52
20	UTI_N	UTI NUEVO		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Estructura de la Sección VI: Información sobre intercambios de importe base o pago o recepción de cuota compensatoria, para operaciones reportadas en las sección II, III o IV

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INSTI	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	IMB_C	INDICADOR DE INTERCAMBIO DE IMPORTE BASE O CUOTA COMPENSATORIA		CARÁCTER	1
4	SEC_SWAP	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(1,0)
5	NU_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
6	FE_LQ_FLU_RE	FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
7	IMP_BA_RE_I	IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE RECIBE, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
8	MDA_IMP_RE_I	MONEDA DEL IMPORTE QUE SE RECIBE	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
9	FE_LQ_FLU_EN	FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
10	IMP_BA_EN_I	IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE ENTREGA, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
11	MD_IMP_EN_I	MONEDA DEL IMPORTE QUE SE ENTREGA	ANEXO E	NUMÉRICO	(3,0)
12	NU_SEC	NÚMERO SECUENCIAL PARA IDENTIFICAR INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE (O CUOTA COMPENSATORIA)		NUMÉRICO	(3,0)
13	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
14	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

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

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	PRO_TER	ORIGEN DE LA POSICIÓN		CARACTER	1
4	CLIENTE	CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
5	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
6	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
7	POS_OPER	PIZARRA DE LA OPERACIÓN		CARACTER	1
8	PIZARRA	CLAVE DE PIZARRA	ANEXO AA	ALFANUMÉRICO	20
9	SOCIO_LIQ	SOCIO LIQUIDADOR	ANEXO O	CARACTER	6
10	CONTRAT_VIG	NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES EN LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(6,0)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

11	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
12	ACT_OPE	VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
13	PAS_OPE	VALUACION DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(15,0)
14	DUR_ACT	DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
15	DUR_PAS	DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
16	ID_GAR	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANÚMÉRICO	20
17	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20

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

CAMPO	CLAVE	CONCEPTO	CATÁLOGO	LAYOUT	
1	INST	CLAVE DE LA INSTITUCIÓN	SAIF-WEB	CARÁCTER	6
2	FE_CON_OPE	FECHA DE CONCERTACIÓN		FECHA	AAAA/MM/DD
3	SEC_SWAP	SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(1,0)
4	FE_CORTE	FECHA DE CORTE		FECHA	AAAA/MM/DD
5	NUM_ID	NÚMERO DE IDENTIFICACION DE LA OPERACIÓN		ALFANUMÉRICO	34
6	FE_VEN_FLU_R	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A RECIBIR		FECHA	AAAA/MM/DD
7	FE_VEN_FLU_E	FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A ENTREGAR		FECHA	AAAA/MM/DD
8	OBJ_OPE	OBJETIVO DE LA OPERACIÓN	ANEXO D	CARÁCTER	2
9	ACT_OPE	VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
10	ACT_OPE_ME	VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
11	PAS_OPE_MR	VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR		NUMÉRICO	(15,0)
12	PAS_OPE	VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR		NUMÉRICO	(15,0)
13	DUR_ACT	DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
14	DUR_PAS	DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN		NUMÉRICO	(5,0)
15	ID_GAR	CLAVE O FOLIO PARA IDENTIFICAR EL CONTRATO QUE GARANTIZA LA OPERACIÓN		ALFANÚMÉRICO	20
16	INST_LEI	CÓDIGO LEI (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "LEGAL ENTITY IDENTIFIER") DE LA INSTITUCIÓN.	ANEXO B	ALFANUMÉRICO	20
17	UTI	IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN (DENOMINADO EN INGLÉS COMO "UNIQUE TRANSACTION IDENTIFIER")		ALFANUMÉRICO	52

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Ayudas específicas para cada campo del formulario

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

Sección I.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados reconocidos

1. CLAVE DE LA 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. 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 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) 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 es por cuenta propia, deberá registrarse el Código LEI de la institución (campo 17 “Código LEI de la Institución”).

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

5. MERCADO

Se deberá anotar la clave del “mercado” dónde se realizó la operación, 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 operación, con formato AAAA/MM/DD.

7. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar:

- 1 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa fija por una tasa variable.
- 2 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa variable por otra tasa variable.
- 3 Cuando se trate de una operación en la que se intercambia una tasa fija por otra tasa fija.

8. CLAVE DE PIZARRA

Se deberá anotar la “clave de pizarra” que corresponda a la operación, conforme al “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo AA. Para operaciones celebradas en el MEXDER. La pizarra deberá estar en el “Boletín Diario” publicado por dicho mercado, adicionalmente si ésta no se encuentra en el Anexo AA, se deberá solicitar con anticipación su inclusión, en caso de que una operación realizada en el MEXDER no cumpla con estas características, favor de comunicarse con la Oficina del Registro de Operaciones Derivadas para su aclaración.

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. Si durante la vida de la operación el Objetivo de ésta cambia, éste deberá reflejar exclusivamente en la Sección VII.

10. NÚMERO DE CONTRATOS

Se deberá anotar el número de contratos negociados en la operación de que se trate (en unidades). Para el caso de operaciones en el MEXDER, éste no deberá ser mayor al reportado en el Boletín Diario.

11. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

En caso que la operación reciba una tasa fija (claves “1” o “3” en el campo 7), en este campo se debe anotar la tasa fija a recibir, anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 3.264%, se anotará: 3.264.

Tratándose de operaciones que reciban una tasa variable (clave “2” en el campo “7”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

12. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

En caso que la operación entregue una tasa fija (claves “1” o “3” en el campo 7), en este campo se debe anotar la tasa fija a entregar, anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 3.264%, se anotará: 3.264.

Tratándose de operaciones que entreguen una tasa variable (clave “2” en el campo “7”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

13. 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 que la operación tenga asignado un número único (“Unique Swap Identifier” o USI), dicho USI debe registrarse en este campo. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

14. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

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

15. OPERADOR DE LA OPERACIÓN

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

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

16. CÁMARA DE COMPENSACIÓN

Se deberá anotar la clave asignada a la “Cámara de Compensación” por medio de la cual se liquidará la operación celebrada en el mercado a que se refiere el campo 5, conforme al “Catálogo de Cámaras de Compensación o Repositorio de Derivados” a que se refiere el Anexo L.

17. 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.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con un importe base de referencia (“Interest Rate Swaps”)

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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 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 anotar el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar la “clave” del tipo de producto derivado (Taxonomía ISDA) que corresponda a la operación (“29”, “30”, “31”, “32” o “33”), conforme al “Catálogo de Tipo de Producto Derivado”, a que se refiere el Anexo C.

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. Si durante la vida de la operación el Objetivo de ésta cambia, éste deberá reflejarse exclusivamente en la Sección VIII.

11. REVISIÓN DE LOS “PARÁMETROS” DEL “SWAP”

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que durante el tiempo de su vigencia, alguno o algunos de los “parámetros principales” con los que se determinan los flujos (a recibir, a entregar, o ambos, en su caso) estarán sujetos a revisión; en este campo se deberá anotar cuál o cuáles de tales parámetros, y en qué forma estarán sujetos a dicha revisión, conforme al “Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap” a que se refiere el Anexo H. En caso que el contrato no establezca revisión de parámetros, se deberá anotar “Sin Revisión de Parámetros” (clave “SINRP” en el Anexo H).

En su caso, los campos sujetos al evento de “revisión de los parámetros del swap” son los siguientes: 13, 20, 21, 22, 23, 25, 26, 27, 28, 29, 30, 31, 32, 34, 35, 36 y 37.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

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 esta sea día inhábil; conforme al “Catálogo de Convención de Días Inhábiles para el Cálculos de los Flujos” a que se refiere el Anexo I.

13. IMPORTE BASE DEL CONTRATO

Se deberá anotar el importe base, establecido en el contrato de que se trate, redondeado sin decimales, expresado en miles de unidades de la moneda de denominación establecida en dicho contrato.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

14. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL IMPORTE BASE

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base (del campo 13) de la operación, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

15. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

Se deberá anotar el número de días hábiles posteriores, a la fecha de vencimiento de cada flujo, para la liquidación respectiva, conforme al contrato de la operación. Si los flujos a recibir y entregar se liquidan el mismo día de su vencimiento, en este campo se reportará cero “0”. En caso que los flujos a recibir y entregar tengan distintos números de días para

Uso Público

Información de acceso público.

liquidar, se debe anotar el número mayor. Para el caso de operaciones cuyos flujos se liquiden hasta el final de la operación, en este campo deberá reportar “00”.

16. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Se deberá anotar el número total de flujos a RECIBIR pactados en la operación. En caso de operaciones que sean restructuradas, cesiones de derechos u otras situaciones que impliquen el cambio de las características pactadas originalmente, en este campo se deberá reportar el remante de los flujos de la operación al momento en que suceda tal acuerdo.

17. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Se deberá anotar el número total de flujos a ENTREGAR pactados en la operación. En caso de operaciones que sean restructuradas, cesiones de derechos u otras situaciones que impliquen el cambio de las características pactadas originalmente, en este campo se deberá reportar el remante de los flujos de la operación al momento en que suceda tal acuerdo.

18. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a RECIBIR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de cobro de cada flujo a recibir.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a RECIBIR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30
Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: “*cada 182 días comenzando el ...*” en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

19. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a ENTREGAR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de pago de cada flujo a entregar.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a ENTREGAR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30
Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: *“cada 182 días comenzando el ...”* en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

20. TIPO DE TASA A RECIBIR

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de interés a recibir en la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

21. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa fija a RECIBIR (“TIF” en el campo “20”), anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 4.375%, se anotará: 4.375.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa variable (claves “TIM” o “TIX” en el campo “20”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

22. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a RECIBIR (claves “TIM” o “TIX” en el campo “20”) 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.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), se deberá anotar la clave “NA” (equivalente a no aplica).

23. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR

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 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 (campo 18).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

24. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (RECIBIR)

Se deberá anotar:

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

25. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

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; conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

26. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” o “TIX” en el campo “20”) 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: 0.75.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” considere el 100% de la “tasa de referencia”; en este campo se deberá reportar 1 (uno).

En el caso de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

27. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” o “TIX” en el campo “20”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de referencia); en este campo se deberá anotar el signo más “+” o el signo menos “-”, según corresponda. Por ejemplo, en

Uso Público

Información de acceso público.

caso que la tasa variable resulte de sumar 0.35% a la LIBOR-USD a 90 días, en este campo se anotará: “+”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), este campo deberá reportarse “vacío”.

28. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” o “TIX” en el campo “20”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de 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”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “20”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

29. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de interés a entregar en la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

30. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa fija a ENTREGAR (“TIF” en el campo “29”), anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 3.645%, se anotará: 3.645.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que entreguen tasa variable (claves “TIM” o “TIX” en el campo “29”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

31. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a ENTREGAR (claves “TIM” o “TIX” en el campo “29”) 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.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “29”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

32. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar, en su caso, el tamaño con el que se revisa o actualiza la tasa de referencia de la operación, expresado en número de días naturales. Con este intervalo se calcula la tasa de interés con la que se determinan los intereses a entregar por 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 entregar (campo 19). Por ejemplo, si para determinar la tasa de interés, la tasa de referencia se debe revisar o actualizar quincenalmente, entonces en este campo deberá registrarse 15 (quince).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que entreguen tasa fija (“TIF” en el campo “29”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

33. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (ENTREGAR)

Se deberá anotar:

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

34. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

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 entregar; conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa (o Precio) de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Uso Público

Información de acceso público.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “29”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

35. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves TIM” o “TIX en el campo “29”) 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 80% de la TIE a 28 días, en este campo se anotará: 0.8.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” considere el 100% de la “tasa de referencia”; en este campo se deberá reportar 1 (uno).

Tratándose de operaciones que entreguen tasa fija (“TIF” en el campo “29”), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

36. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves TIM” o “TIX en el campo “29”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de referencia); en este campo se deberá anotar el signo más “+” o el signo menos “-”, según corresponda. 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: “+”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “29”), este campo deberá reportarse “vacío”.

37. PUNTOS PORCENTUALES A APLICAR A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves TIM” o “TIX en el campo “29”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de 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: “0.35”.

Uso Público

Información de acceso público.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “29”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

38. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas a recibir y entregar se ubiquen en niveles inferiores o superiores al mercado, según corresponda, en este campo deberán anotar la clave correspondiente conforme al “Catálogo de Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Catálogo X.

La fecha y el importe de la cuota compensatoria (“Up front fee”), que la institución “Recibe” (“R” o “F” en este campo) o “Entrega” (“S” o “E” en este campo) o “Recibe y Entrega” (“A” en este campo), debe reportarse en la Sección VI de este formulario.

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas, a recibir y a entregar, se ubiquen en niveles “de mercado”, por lo que no se pacta el pago de una cuota compensatoria (“Up front fee”), en este campo deberá anotar “N” como se indica en el Catálogo X.

39. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Se deberá anotar:

- P** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada del mismo, ya sea en forma parcial o total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado. En el primer caso, se ajusta únicamente el importe base, y prevalecen el resto de las condiciones pactadas.
- T** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada únicamente de forma total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado.

40. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- M** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de mercado predeterminadas (nivel de la tasa de referencia, etc.).
- C** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de crédito predeterminadas (calidad crediticia de la contraparte, etc.).
- N** Cuando el contrato respectivo no contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes.

41. LA OPERACIÓN FORMA PARTE DE UNA “OPERACIÓN ESTRUCTURADA” O “PAQUETE”

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 III” Genérica, se deberá anotar la clave que corresponda (“6”, “28”, “44”, “46”, “49” o “90”) 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).

42. 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” (claves “6”, “28”, “44”, “46” o “49” en el campo 41), 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 transacción. 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 41) este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

43. 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” (claves “6”, “28”, “44”, “46”, o “49” en el campo 41), 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 transacción. 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 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 42).

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (“90” en el campo 41), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

44. 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.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

45. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

En su caso, se deberá anotar la clave asignada al “Socio Liquidador” por medio del cual se liquidará la operación, en la cámara de compensación a que se refiere el campo 46, 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 dichos socios liquidadores, en este campo se deberá anotar la clave “077000” (equivalente a no aplica).

46. 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).

47. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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 General de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. En caso que la institución actúe como 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 equivalente al 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”.

48. 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 correspondiente. Sin embargo, las instituciones podrán utilizar este campo como identificador de los cambios internos en la operación, por lo que el campo “número de identificación de la operación” no se deberá modificar.

49. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar un número para identificar cada operación o contrato individual, 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 4). El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

Uso Público

Información de acceso público.

50. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una operación derivada, en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en el formulario “OPTO”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente no sea una operación derivada, este campo deberá reportarse “vacío”.

51. 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.

52. 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.

Sección II Complemento (“Interest Rate SWAPS”)

Este complemento debe enviarse para cada operación o contrato en los que al menos uno de sus “parámetros principales”, a recibir y/o entregar, se modifique en algún momento de su vigencia. De ser el caso, deberá enviarse el detalle de todos y cada uno de los flujos que comprendan dicha operación.

En el caso que para una operación determinada, el número de flujos a recibir sea distinto (mayor o menor) del número de flujos a entregar, el número total de registros que se reporte en esta sección debe corresponder al número de flujos (ya sea a recibir o entregar) que sea mayor; adicionalmente el (o los) “parámetro(s) principal(es)” que se modifiquen deben reportarse precisamente respecto de dichos flujos, a recibir o entregar, el que sea mayor. Asimismo, el primer flujo, tanto a recibir

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

como entregar, debe reportarse a partir del primer registro de la operación de que se trate, mientras que el resto de los flujos (a recibir y entregar) deben reportarse en forma sucesiva.

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 vigente de la operación conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Asimismo, se deberá anotar la misma clave de contraparte (conforme al Anexo B) que la reportada en el campo “3” de la Sección II para la operación correspondiente.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

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 (con formato AAAA/MM/DD).

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el mismo número de identificación que el reportado en el campo “49” de la Sección II para la operación correspondiente.

5. IMPORTE BASE DEL FLUJO

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el “importe base” estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno los flujos 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.

6. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a recibir de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 3) y número de identificación (campo 4).

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a recibir de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) de cada flujo a recibir de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. TIPO DE TASA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el tipo de tasa a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar el tipo de tasa que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

10. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el valor de la tasa fija a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de la tasa fija a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

11. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la tasa de referencia a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la tasa de referencia a recibir (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

12. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el operador aplicable a la tasa de referencia a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el operador aplicable a la tasa de referencia a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

13. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir estarán sujetos a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de los puntos porcentuales aplicables a la tasa de

Uso Público

Información de acceso público.

referencia a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

14. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la modalidad con la cual la tasa de referencia a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la modalidad de revisión de la tasa de referencia a recibir (conforme al Anexo V) que aplicará para cada uno los flujos 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 debe ser igual a “NA” (No aplica).

15. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a entregar de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 3) y número de identificación (campo 4).

16. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a entregar de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

17. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) de cada flujo a entregar de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

18. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el tipo de tasa a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar el tipo de tasa que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

19. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el valor de la tasa fija a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de la tasa fija a recibir que aplicará para cada uno los flujos correspondientes. En caso

Uso Público

Información de acceso público.

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 debe reportarse vacío.

20. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la tasa de referencia a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la tasa de referencia a entregar (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

21. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el operador aplicable a la tasa de referencia a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el operador aplicable a la tasa de referencia a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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.

22. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir estarán sujetos a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a entregar que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse vacío.

23. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la modalidad con la cual la tasa de referencia a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la modalidad de revisión de la tasa de referencia a entregar (conforme al Anexo V) que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse “NA” (No aplica).

24. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

25. 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 SWAPS.

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.

Sección III.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos, sobre tasas de interés y con dos importes base de referencia (“Cross Currency Swaps”)

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

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Se deberá anotar la “clave” del tipo de producto derivado (Taxonomía ISDA) que corresponda a la operación (“34”, “35”, o “36”), conforme al “Catálogo de Tipo de Swap” a que se refiere el Anexo C.

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. Si durante la vida de la operación el Objetivo de ésta cambia, éste deberá reflejarse exclusivamente en la Sección VIII.

11. REVISIÓN DE LOS “PARÁMETROS” DE LA OPERACIÓN

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que durante el tiempo de su vigencia, alguno o algunos de los “parámetros principales” con los que se determinan los flujos (a recibir, a entregar, o ambos, en su caso) estarán sujetos a revisión; en este campo se deberá anotar cuál o cuáles de tales parámetros, y en qué forma estarán sujetos a dicha revisión, conforme al “Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap” a que se refiere el Anexo H. En el caso de que el contrato no establezca revisión de parámetros, se deberá anotar “Sin Revisión de Parámetros” (clave “SINRP” en dicho Anexo). Adicionalmente, si hubiera uno o varios flujos que durante la vida del swap, sea el tamaño del intervalo diferente al pactado, entonces se deberá de enviar el detalle de cada uno de éstos en la Sección III complemento, para cualquier duda comunicarse a la oficina de derivados de Banco de México.

En su caso, los campos sujetos al evento de “revisión de los parámetros del swap” son los siguientes: 14, 16, 21, 22, 23, 24, 25, 26, 28, 29, 30, 31, 32, 33, 34, 35, 37, 38, 39 y 40.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 esta sea día inhábil; conforme al “Catálogo de Convención de Días Inhábiles para las Fechas de Vencimiento de los Flujos del Swap”, a que se refiere el Anexo I.

13. MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que durante la vigencia de éstas, los importes base con que se determinan los flujos estarán sujetos a intercambio (al principio, al final, al principio y al final de la operación o sus variantes); en este campo se deberá anotar la clave que corresponda, conforme al “Catálogo de Modalidades de Intercambio de los Importes Base del Swap”, a que se refiere el Anexo Q. En el caso que el contrato no establezca intercambio de importes base, se deberá anotar “Sin Intercambio de Importes base” (clave “S” en el Anexo “Q”).

14. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Se deberá anotar el importe base con el que se calculan los flujos a recibir, establecido en el contrato de que se trate, redondeado sin decimales, expresado en miles de unidades de la moneda de denominación establecida en dicho contrato.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

15. MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base, relativo a los flujos a recibir (campo 14), de la operación, conforme al “Catálogo de Monedas”, a que se refiere el Anexo E.

16. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Se deberá anotar el importe base con el que se calculan los flujos a entregar, establecido en el contrato de que se trate, redondeado sin decimales, expresado en miles de unidades de la moneda de denominación establecida en dicho contrato.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

17. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base, relativo a los flujos a entregar (campo 16), de la operación, conforme al “Catálogo de Monedas”, a que se refiere el Anexo E.

18. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

Se deberá anotar, de ser el caso, el número de días hábiles posteriores, a la fecha de vencimiento de cada flujo, para la liquidación respectiva, conforme al contrato de la operación. Si los flujos a RECIBIR y ENTREGAR se liquidan el mismo día de su vencimiento, en este campo se reportará cero “0”. Para el caso de operaciones cuyos flujos se liquiden hasta el final de la operación, en este campo deberá reportar “00”.

19. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar el número total de flujos a RECIBIR pactados en la operación. En caso de operaciones que sean restructuradas, cesiones de derechos u otras situaciones que impliquen el cambio de las características pactadas originalmente, en este campo se deberá reportar el remante de los flujos de la operación al momento en que suceda tal acuerdo.

20. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Se deberá anotar el número total de flujos a ENTREGAR pactados en la operación. En caso de operaciones que sean restructuradas, cesiones de derechos u otras situaciones que impliquen el cambio de las características pactadas originalmente, en este campo se deberá reportar el remante de los flujos de la operación al momento en que suceda tal acuerdo.

21. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a RECIBIR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de cobro de cada flujo a recibir.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a RECIBIR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30
Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: *“cada 182 días comenzando el ...”* en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

22. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a ENTREGAR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de pago de cada flujo a entregar.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a ENTREGAR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30
Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: “*cada 182 días comenzando el ...*” en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

23. TIPO DE TASA A RECIBIR

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de interés a recibir en la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

24. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa fija a RECIBIR (“TIF” en el campo “23”), anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 2.814%, se anotará: 2.814.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa variable (claves “TIM” y “TIX” en el campo “23”), este campo debe reportarse con “0” (cero).

25. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a RECIBIR (claves “TIM” y “TIX” en el campo “23”) 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.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

26. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar, en su caso, el tamaño con el que se revisa o actualiza la tasa de referencia de la operación, expresado en número de días naturales. Con este intervalo se calcula la tasa de interés con la que se determinan los intereses a recibir 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 (campo 21). 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).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

27. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A RECIBIR)

Se deberá anotar:

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

28. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

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; conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), se deberá anotar la clave “NA” (equivalente a no aplica).

29. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “23”) 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 120% de la TIIE a 28 días, en este campo se anotará: “1.2”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” considere el 100% de la “tasa de referencia”; en este campo se deberá reportar “1” (uno).

En el caso de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

30. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “23”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de referencia); en este campo se deberá anotar el signo más “+” o el signo menos “-”, según corresponda. Por ejemplo, en caso que la tasa variable resulte de sumar 0.23% a la LIBOR-USD a 28 días, en este campo se anotará: “+”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), este campo deberá reportarse “vacío”.

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

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “23”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de referencia); en este campo se

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 0.23% a la LIBOR-USD a 28 días, en este campo se anotará: “0.23”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “23”), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

32. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Se deberá anotar la clave del tipo de tasa de interés a recibir en la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo F.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

33. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa fija a ENTREGAR (“TIF” en el campo “32”), anualizada, con enteros y hasta seis decimales. Por ejemplo, en caso de una tasa fija anual de 5.38%, se anotará: 5.38.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que entreguen tasa variable (claves “TIM” y “TIX” en el campo “32”), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

34. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Se deberá anotar, en su caso, la tasa de referencia que vaya a ser utilizada para determinar la tasa variable a ENTREGAR (claves “TIM” y “TIX” en el campo “32”) 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.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

35. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar, en su caso, el tamaño con el que se revisa o actualiza la tasa de referencia de la operación, expresado en número de días naturales. Con este intervalo se calcula la tasa de interés con la que se determinan los intereses a entregar por 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 entregar (campo 22). Por ejemplo, si para determinar la tasa de interés, la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

tasa de referencia se debe revisar o actualizar semanalmente, entonces en este campo deberá registrarse 7 (siete).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

36. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A ENTREGAR)

Se deberá anotar:

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

37. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

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 entregar; conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

38. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “32”) 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 85% de la TIIE a 28 días, en este campo se anotará: “0.85”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” considere el 100% de la “tasa de referencia”; en este campo se deberá reportar 1 (uno).

En el caso de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

39. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “32”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de referencia); en este campo se deberá anotar el signo más “+” o el signo menos “-”, según corresponda. Por ejemplo, en caso que la tasa variable resulte de sumar 0.18% a la LIBOR-USD a 182 días, en este campo se anotará: “+”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a RECIBIR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), este campo deberá reportarse “vacío”.

40. PUNTOS PORCENTUALES A APLICAR A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Cuando, y conforme al contrato de la operación, en la fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” (claves “TIM” y “TIX” en el campo “32”) se requiera sumar o restar puntos porcentuales (al producto del factor aplicable por la tasa de 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 0.18% a la LIBOR-EUR a 30 días, en este campo se anotará: “0.18”.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Tratándose de operaciones cuya fórmula para obtener la “tasa variable a ENTREGAR” no requiera sumar o restar puntos porcentuales a la “tasa de referencia”; así como de operaciones que reciban tasa fija (“TIF” en el campo “32”), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

41. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas a recibir y entregar se ubiquen en niveles inferiores o superiores al mercado, según corresponda, en este campo deberán anotar la clave correspondiente conforma al “Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Anexo “X”.

La fecha y el importe de la cuota compensatoria (“up front fee”), que la Institución “Recibe” (“R” o “F” en este campo) o “Entrega” (“S” o “E” en este campo), deberá reportarse en la Sección VI de este formulario.

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas, a recibir y a entregar, se ubiquen en niveles “de mercado”, por lo que no se pacta el pago de una cuota compensatoria (“up front fee”), en este campo deberá anotar “N” como se indica en el Anexo “X”.

42. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Se deberá anotar:

- P** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada del mismo, ya sea en forma parcial o total, conforme al valor de mercado de la operación

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

a la fecha de vencimiento anticipado. En el primer caso, se ajusta únicamente el importe base, y prevalecen el resto de las condiciones pactadas.

- T Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada únicamente de forma total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado.

43. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- M Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de mercado predeterminadas (nivel de la tasa de referencia, etc.).
- C Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de crédito predeterminadas (calidad crediticia de la contraparte, etc.).
- N Cuando el contrato respectivo no contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes.

44. 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 III” Genérica, se deberá anotar la clave que corresponda (“6”, “28”, “44”, “46” o “49”) 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) del Catálogo “J”.

45. 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” (claves “6”, “28”, “44”, “46” o “49” en el campo 44), 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 transacción. 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 44) este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

46. 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” (claves “6”, “28”, “44”, “46” o “49” en el campo 44), 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 transacción. 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

misma clave de institución (campo 1), fecha de concertación (campo 6) y clave o folio con el que se identifica al conjunto de operaciones que formen parte de una “operación estructurada” o “paquete” (campo 44).

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (“90” en el campo 44), este campo deberá reportarse con “0” (cero).

47. 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).

48. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” por medio de la cual se liquidará la operación, en la cámara de compensación a que se refiere el campo 49, 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).

49. 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).

50. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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 General de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. En caso que la institución actúe como 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 equivalente al 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”.

51. 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 correspondiente.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sin embargo, las instituciones podrán utilizar este campo como identificador de los cambios internos en la operación, por lo que el campo “número de identificación de la operación” no se deberá modificar.

52. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar un número para identificar cada operación o contrato individual, 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 4). El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

53. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una operación derivada, en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en los formularios “OPTO” o al formulario relativo a operaciones de derivados de crédito, según corresponda.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente no sea una operación derivada, este campo deberá reportarse “vacío”.

54. 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.

55. 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.

Sección III Complemento (“CROSS CURRENCY SWAPS”)

Este complemento debe enviarse para cada operación o contrato en los que al menos uno de sus “parámetros principales”, a recibir y/o entregar, se modifique en algún momento de su vigencia. De

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

ser el caso, deberá enviarse el detalle de todos y cada uno de los flujos que comprendan dicha operación. En el caso que para una operación determinada, el número de flujos a recibir sea diferente del número de flujos a entregar, el número total de registros que se reporte debe corresponder al número de flujos (ya sea a recibir o entregar) que sea mayor; adicionalmente el (o los) “parámetro(s) principal(es)” que se modifiquen deben reportarse precisamente respecto de dichos flujos (a recibir o entregar, el que sea mayor). 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 III para la operación correspondiente.

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Asimismo, se deberá anotar la misma clave de contraparte (conforme al Anexo B) que la reportada en el campo “3” de la Sección III para la operación correspondiente.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

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 (con formato AAAA/MM/DD).

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el mismo número de identificación que el reportado en el campo “52” de la Sección III para la operación correspondiente. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

5. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a recibir de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignársele a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 2) y número de identificación (campo 4).

6. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el importe base para el cálculo de los flujos a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno los flujos a recibir 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.

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a recibir de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. TIPO DE TASA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el tipo de tasa a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar el tipo de tasa que aplicará para cada uno los flujos 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. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el valor de la tasa fija a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, en su caso, el valor de la tasa fija a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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.

11. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la tasa de referencia a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la tasa de referencia a recibir (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los flujos 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.

12. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el operador aplicable a la tasa de referencia a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el operador aplicable a la tasa de referencia a recibir que aplicará para cada uno los flujos correspondientes. En caso que este campo no sea un “parámetro principal” sujeto a

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

revisión, o bien no se modifique para el flujo de que se trate, este campo deberá reportarse vacío.

13. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir estarán sujetos a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a recibir que aplicará para cada uno los flujos 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.

14. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que, durante la vigencia de la operación, la modalidad con la cual la tasa de referencia a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la modalidad de revisión de la tasa de referencia a recibir (conforme al Anexo V) que aplicará para cada uno los flujos 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 debe reportarse “NA” (No Aplica).

15. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a entregar de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 2) y número de identificación (campo 3).

16. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el importe base para el cálculo de los flujos a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno los flujos a entregar 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.

17. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a entregar de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

18. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

19. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el tipo de tasa a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar el tipo de tasa que aplicará para cada uno los flujos 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.

20. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el valor de la tasa fija a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar, en su caso, el valor de la tasa fija a entregar que aplicará para cada uno los flujos 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.

21. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la tasa de referencia a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la tasa de referencia a recibir (conforme al Anexo AF) que aplicará para cada uno los flujos 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.

22. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el operador aplicable a la tasa de referencia a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el operador aplicable a la tasa de referencia a entregar que aplicará para cada uno los flujos 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.

23. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a entregar estarán sujetos a revisión, en este campo se deberá anotar el valor de los puntos porcentuales aplicables a la tasa de referencia a entregar que aplicará para cada uno los flujos 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.

24. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que, durante la vigencia de la operación, la modalidad con la cual la tasa de referencia a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar la modalidad de revisión de la tasa de referencia a entregar (conforme al Anexo V) que aplicará para cada uno de los flujos correspondientes.

En caso de 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 debe reportarse “NA” (No aplica).

25. 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.

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

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme a 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 III del formulario SWAPS.

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.

Sección IV.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre subyacentes distintos a tasas de interés

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 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 anotar el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”.

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

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

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio del primer flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Se deberá anotar la “clave” del tipo de producto derivado (Taxonomía ISDA) que corresponda a la operación (“37”, “38”, “39”, “40”, “41”, “42”, “43”, “44”, “45”, “46” o “47”), conforme al “Catálogo de Tipo de Producto Derivado” a que se refiere el Anexo C.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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. Si durante la vida de la operación el Objetivo de ésta cambia, éste deberá reflejarse exclusivamente en la Sección VIII.

11. REVISIÓN DE LOS “PARÁMETROS” DEL “SWAP”

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que durante el tiempo de su vigencia, alguno o algunos de los “parámetros principales” con los que se determinan los flujos (a recibir, a entregar, o ambos, en su caso) estarán sujetos a revisión; en este campo se deberá anotar cuál o cuáles de tales parámetros, y en qué forma estarán sujetos a dicha revisión, conforme al “Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap” a que se refiere el Anexo H. En el caso de que el contrato no establezca revisión de parámetros, se deberá anotar “Sin Revisión de Parámetros” (clave “SINRP” en el Anexo H). Adicionalmente, si hubiera uno o varios flujos que durante la vida del swap, sea el tamaño del intervalo diferente al pactado, entonces se deberá enviar el detalle de cada uno de éstos en la Sección IV Complemento, para cualquier duda comunicarse a la oficina de derivados de Banco de México.

En su caso, los campos sujetos al evento de “revisión de los parámetros del swap” son los siguientes: “14”, “16”, “29”, “31”, “33”, “35”, “36”, “38”, “40” y “42”.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

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 esta sea día inhábil; conforme al “Catálogo de Convención de Días Inhábiles para las Fechas de Vencimiento de los Flujos del Swap” a que se refiere el Anexo I.

13. MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que durante la vigencia de éstas, los importes base con que se determinan los flujos estarán sujetos a intercambio (al principio, al final, al principio y al final de la operación o sus variantes); en este campo se deberá anotar cómo estarán sujetos a dicho intercambio, conforme al “Catálogo de Modalidades de Intercambio de los Importes Base del swap”, a que se refiere el Anexo Q. En el caso de que el contrato no establezca intercambio de importes base, se deberá anotar “Sin Intercambio de Importes base” (clave “S” del Anexo Q).

14. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

Se deberá anotar: a) el importe base, con el que se determinan los flujos a recibir (ya sea por aplicar un rendimiento porcentual o tasa de interés), o b) el valor contractual del subyacente a recibir; establecido en el contrato de que se trate, redondeado sin decimales, expresado en miles de unidades de la moneda de denominación establecida en dicho contrato.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

15. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base, o valor contractual, con el que se determinan los flujos a recibir (del campo 14), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

16. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

Se deberá anotar: a) el importe base, con el que se determinan los flujos a entregar (ya sea por aplicar un rendimiento porcentual o tasa de interés), o b) el valor contractual del subyacente a entregar; establecido en el contrato de que se trate, redondeado sin decimales, expresado en miles de unidades de la moneda de denominación establecida en dicho contrato.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

17. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)

Se deberá anotar la clave de la moneda en que esté denominado el importe base, o valor contractual, con el que se determinan los flujos a entregar (campo 16), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

18. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

Se deberá anotar, de ser el caso, el número de días hábiles posteriores, a la fecha de vencimiento de cada flujo a RECIBIR y a ENTREGAR, para la liquidación respectiva, conforme al contrato de la operación. Si los flujos a RECIBIR y ENTREGAR se liquidan el mismo día de su vencimiento, en este campo se reportará cero “0”. Para el caso de operaciones cuyos flujos se liquiden hasta el final de la operación, en este campo deberá reportar “00”.

19. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Se deberá anotar el número total de flujos a RECIBIR pactados en la operación.

20. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Se deberá anotar el número total de flujos a ENTREGAR pactados en la operación.

21. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a RECIBIR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de cobro de cada flujo a recibir.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a RECIBIR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30

Uso Público

Información de acceso público.

Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: “*cada 182 días comenzando el ...*” en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

22. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar el intervalo de tiempo, en días naturales, de los flujos a ENTREGAR de la operación (con enteros y sin decimales). Con este intervalo se determina el periodo de pago de cada flujo a entregar.

Por ejemplo, si el tiempo que transcurre entre cupones es de 28 días naturales, se deberá reportar 28. Asimismo, en caso de operaciones en las que para los flujos a ENTREGAR del swap se apliquen convenciones mensuales, bimestrales, trimestrales, semestrales o anuales, deberá ocuparse la siguiente regla, siempre y cuando sea consistente con la carta confirmación:

Plazo	Intervalo del flujo a reportar
Mensual	30
Bimestral	60
Trimestral	90
Semestral	180
Anual	De acuerdo con el convenio que corresponda: 360 o 365.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

No obstante, si la carta confirmación explícitamente indica el tamaño de los intervalos de los flujos deberá reportarse dicho valor; por ejemplo, si la carta confirmación dice: *“cada 182 días comenzando el ...”* en el reporte deberá indicarse 182 días.

Si la diferencia entre las fechas de inicio y de vencimiento para todos los flujos en la operación es siempre la misma, se deberá reportar dicha diferencia en el intervalo.

En caso de que los intervalos tengan periodos explícitamente irregulares (por ejemplo, con algunos flujos con intervalos de 28 días en tanto que otros tengan un intervalo de 30 días) deberá reportarse el dato que más se repita. En caso de que la operación presente más de un intervalo con mayor frecuencia, deberá reportarse el promedio del tamaño de todos los intervalos, redondeado a cero decimales, considerando que si el primer decimal es igual o mayor a cinco se redondea al entero superior.

Por último, si existe un solo cupón, deberá reportarse el valor que resulte de la diferencia de días naturales entre la fecha final menos fecha inicial del cupón.

23. TIPO DE LIQUIDACIÓN

En el caso de operaciones en las que en cada flujo se intercambien un número determinado de subyacentes (distintos a tasas de interés e índices), se deberá anotar:

- S** Cuando el contrato establezca que el flujo correspondiente se liquide mediante “entrega del subyacente”.
- D** Cuando el contrato establezca que el flujo correspondiente se liquide “por diferencias”.

En el caso que ambos flujos se determinen aplicando un rendimiento porcentual al importe base, en este campo deberá reportarse invariablemente la clave “D”.

24. MONEDA DE LIQUIDACIÓN

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que la operación será liquidada “por diferencias” (“D” en el campo 23), en este campo se deberá anotar la moneda con que se liquidará “la diferencia”, conforme al “Catálogo de Monedas”, a que se refiere el Anexo E.

En caso de que el contrato establezca que la operación será liquidada mediante entrega del subyacente (“S” en el campo 23), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

25. SUBYACENTE A RECIBIR

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

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a recibir sea un tipo de cambio (es decir, “Swaps” en los que se intercambie una divisa por otra que se liquiden por diferencias), en este campo se debe registrar la clave “TIC”, mientras que en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” se debe reportar la clave que

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

corresponda al tipo de cambio de la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones sobre divisas (es decir, “Swaps” en los que se intercambie una divisa por otra que se liquiden por entrega física), en este campo se debe reportar la clave (conforme al Anexo F) de la divisa a recibir. Por su parte, en el campo 32 (Subyacente a entregar) se deberá registrar la clave de la divisa a entregar. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “S”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a recibir 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 en un país extranjero (por ejemplo, la LIBOR). Asimismo, en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” se debe reportar la clave que corresponda a la tasa de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones cuyo subyacente a recibir sea 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 un país extranjero. Asimismo, en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” 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 a recibir 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”, en caso que dicho índice sea cotizado en alguna bolsa de valores de un país extranjero. Asimismo, en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” se debe reportar la clave que corresponda al índice de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones cuyo subyacente a recibir sea 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 un país extranjero. Asimismo, en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” se debe reportar la clave que corresponda al título de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a recibir 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

México, o la clave “TRE”, cuando dicho título fue emitido por una entidad residente en un país extranjero. Asimismo, en el campo “26-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a recibir” se debe reportar la clave correspondiente al título referenciado de que se trate, conforme al Anexo AF.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

En el caso de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando al importe base (campo 14) una tasa de interés fija, en este campo deberá reportarse “TIF” (Tasa de interés fija).

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

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 25), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 25), c) un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 25), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 25), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 25) o f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 25), se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente de que se trate, conforme al “Catálogo de Claves de Títulos de Deuda, Acciones, Índices Accionarios, Tasas de Interés o Tipos de Cambio”, a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, en el caso de operaciones implícitas en un título o nota estructurada, se debe anotar la clave que corresponda a dicho título o nota, conforme al mencionado Anexo AF.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto a los mencionados títulos, tasas de interés, índices accionarios o tipo de cambio, o que no estén implícitos en un título o nota estructurada, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

27. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A RECIBIR

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a recibir sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, o que el contrato respectivo establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a recibir; y por tanto, la forma de calcular los flujos a recibir tiene clave “N” o “M” en el campo 28, en este campo se deberá anotar dicho número de unidades del subyacente a recibir.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (a que se refiere el campo 11).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a recibir sea una divisa, un tipo de cambio o una tasa de interés, o que el contrato respectivo establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando un rendimiento porcentual al importe base (“I” en el campo 28), en este campo deberá reportarse cero (0).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

28. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR

Se deberá anotar:

- N** Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a recibir, por un precio fijo.
- M** Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a recibir (“S” en el campo 23), por el precio de mercado del subyacente vigente en el flujo de que se trate.
- F** Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando al importe base (campo 14) una tasa de interés fija.
- I** Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando al importe base (campo 14): *i*) el rendimiento porcentual del precio de mercado del subyacente (campo 29), observado durante el intervalo que se trate, o *ii*) una tasa de interés variable.

29. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR

Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a recibir, por un precio fijo (“N” en el campo 28), en este campo se deberá anotar, con enteros y hasta seis decimales, el precio fijo por unidad del subyacente a recibir.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando una tasa de interés fija al importe base (“F” en el campo 28), en este campo 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.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina: *i*) utilizando el precio de mercado del subyacente, o *ii*) aplicando un rendimiento porcentual o una tasa de interés variable al importe base (claves “M” o “I” en el campo 28), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

30. MONEDA DEL PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR

Conforme se establezca en el contrato, se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio por unidad de subyacente a recibir (del campo 29), conforme al “Catálogo de Monedas”, a que se refiere el Anexo E.

En caso que el contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina aplicando un rendimiento porcentual o una tasa de interés variable o fija al importe base (“I” o “F” en el campo 28), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

31. MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determine con el precio (o tasa) variable del subyacente, se deberá anotar la clave que corresponda a la modalidad respectiva, conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa (o Precio) de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (a que se refiere el campo 11).

Tratándose de operaciones en las que el precio, rendimiento porcentual o tasa de interés a recibir permanezca fijo en todos y cada uno de sus flujos, en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

32. SUBYACENTE A ENTREGAR

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

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar sea un tipo de cambio (es decir, “Swaps” en los que se intercambie una divisa por otra que se liquiden por diferencias), en este campo se debe registrar la clave “TIC”, mientras que en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave que corresponda al tipo de cambio de la operación de que se trate. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones sobre divisas (es decir, “Swaps” en los que se intercambie una divisa por otra que se liquiden por entrega física), en este campo se debe reportar la clave (conforme al Anexo F) de la divisa a entregar. Por su parte, en el campo 25 (Subyacente a Recibir) se deberá registrar la clave de la divisa a recibir.

Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “S”.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar 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 en un país extranjero (por ejemplo, la LIBOR). Asimismo, en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave que corresponda a la tasa de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones cuyo subyacente a entregar sea 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 un país extranjero. Asimismo, en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave que

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

corresponda a la acción o título representativo de capital de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar 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”, en caso que dicho índice sea cotizado en alguna bolsa de valores de un país extranjero. Asimismo, en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave que corresponda al índice de que se trate, conforme al Anexo AF. Adicionalmente, en el campo “23-Tipo de liquidación” se debe registrar la clave “D”.

En el caso de operaciones cuyo subyacente a entregar sea 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 un país extranjero. Asimismo, en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave que corresponda al título de que se trate, conforme al Anexo AF.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar 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 un país extranjero. Asimismo, en el campo “33-Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a entregar” se debe reportar la clave correspondiente al título referenciado de que se trate, conforme al Anexo AF.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (a que se refiere el campo 11).

En el caso de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determina aplicando al importe base (campo 16) una tasa de interés fija, se deberá anotar la clave “TIF”.

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

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea: a) un tipo de cambio (clave “TIC” en el campo 32), b) una tasa de interés (claves “TIM” o “TIX” en el campo 32), c) un título de deuda (claves “TDM” o “TDE” en el campo 32), d) un título representativo de capital (claves “ACM” o “ACE” en el campo 32), e) un índice accionario (claves “IAM” o “IAX” en el campo 32) o f) un título referenciado (claves “TRM” o “TRE” en el campo 32), se deberá anotar la “clave” que corresponda al subyacente de que se trate, conforme al “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Asimismo, en el caso de operaciones implícitas en un título o nota estructurada, se debe anotar la clave que corresponda a dicho título o nota, conforme al mencionado Anexo AF.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea distinto a los mencionados títulos, índices accionarios, tasas de interés, o tipo de cambio, o que no estén implícitos en un título o nota estructurada, se deberá anotar la clave “NA” (No aplica).

34. NÚMERO DE UNIDADES DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar sea distinto a una divisa, un tipo de cambio o tasa de interés, o que el contrato respectivo establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a entregar (campo 36); y por tanto, la forma de calcular los flujos a recibir tienen clave “N” o “M” en el campo 39, en este campo se deberá anotar dicho número de unidades del subyacente a recibir.

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (a que se refiere el campo 11).

Tratándose de operaciones cuyo subyacente a entregar sea una divisa, un tipo de cambio o una tasa de interés, o que el contrato respectivo establezca que el importe del flujo a recibir se determina: i) utilizando el precio de mercado del subyacente, o ii) aplicando un rendimiento porcentual al importe base (claves “M” o “I” en el campo 39), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

35. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR

Se deberá anotar:

- N** Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a entregar, por un precio fijo.
- M** Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a entregar (“S” en el campo 23), por el precio de mercado del subyacente vigente en el flujo de que se trate.
- F** Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determina aplicando al importe base (campo 16) una tasa de interés fija.
- I** Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determina aplicando al importe base (campo 16): *i*) el rendimiento porcentual del precio de mercado del subyacente (campo 36), observado durante el intervalo que se trate, o *ii*) una tasa de interés variable.

36. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Cuando el contrato establezca que, en cada flujo de la operación, se intercambia un número determinado de unidades del subyacente a entregar, por un precio fijo (“N” en el campo 35), en este campo se deberá anotar, con enteros y hasta seis decimales, el precio fijo por unidad del subyacente a entregar.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determina aplicando una tasa de interés fija al importe base (“F” en el campo 35), en este campo 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.

Tratándose de operaciones cuyo contrato establezca que el importe del flujo a recibir se determina: *i*) utilizando el precio de mercado del subyacente, o *ii*) aplicando un rendimiento porcentual o una tasa de interés variable al importe base (claves “M” o “I” en el campo 35), este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

37. MONEDA DEL PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Conforme se establezca en el contrato, se deberá anotar la clave de la moneda en que está expresado el precio por unidad de subyacente a entregar (del campo 36), conforme al “Catálogo de Monedas”, conforme al Anexo E.

En caso que el contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determina aplicando un rendimiento porcentual o una tasa de interés variable o fija al importe base (“I” o “F” en el campo 35), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

38. MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Cuando el contrato establezca que el importe del flujo a entregar se determine con el precio de mercado (o tasa variable) del subyacente, se deberá anotar la clave que corresponda a la modalidad respectiva, conforme al “Catálogo de Modalidad de la Tasa (o Precio) de Referencia”, a que se refiere el Anexo V.

Tratándose de operaciones en las que el precio, rendimiento porcentual o tasa de interés a recibir permanezca fijo en todos y cada uno de sus flujos, en este campo deberá reportarse “NA” (No aplica).

Este campo, en su caso, estará sujeto al recurso de “revisión de los parámetros de la operación” (del campo 11).

39. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas a recibir y entregar se ubiquen en niveles inferiores o superiores al mercado, según corresponda, en este campo deberán anotar la clave correspondiente conforme al “Catálogo de Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Anexo “X”.

La fecha y el importe de la cuota compensatoria (“up front fee”), que la Institución “Recibe” (“R” o “F” en este campo) o “Entrega” (“S” o “E” en este campo), deberá reportarse en la Sección VI de este formulario.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Tratándose de operaciones cuyas tasas de interés contratadas, a recibir y a entregar, se ubiquen en niveles “de mercado”, por lo que no se pacta el pago de una cuota compensatoria (“up front fee”), en este campo deberá anotar “N” como se indica en el Catálogo “X”.

40. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Se deberá anotar:

- P** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada del mismo, ya sea en forma parcial o total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado. En el primer caso, se ajusta únicamente el importe base, y prevalecen el resto de las condiciones pactadas.
- T** Cuando el contrato respectivo contemple el vencimiento y la liquidación anticipada únicamente de forma total, conforme al valor de mercado de la operación a la fecha de vencimiento anticipado.

41. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- M** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de mercado predeterminadas (precio del subyacente, nivel de la tasa de referencia, etc.).
- C** Cuando el contrato respectivo contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes, debido a la ocurrencia de condiciones de crédito predeterminadas (calidad crediticia de la contraparte, etc.).
- N** Cuando el contrato respectivo no contemple la terminación (o extinción) del mismo, sin la obligación de liquidación de alguna de las partes.

42. 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 III” Genérica, se deberá anotar la clave que corresponda (“6”, “28”, “44”, “46” o “49”) conforme al “Catálogo de Operaciones Estructuradas o Paquetes” 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) del Anexo J.

43. 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” (claves “6”, “28”, “44”, “46” o “49” en el campo 42), 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

transacción. 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 42) este campo deberá reportarse “vacío”.

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

Tratándose de operaciones que formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (claves “6”, “28”, “44”, “46” o “49” en el campo 42), 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 transacción. 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 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 43).

Tratándose de operaciones que no formen parte de una misma “operación estructurada” o “paquete” (“90” en el campo 42) este campo deberá reportarse “vacío”.

45. 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).

46. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

En su caso, se deberá anotar la clave asignada a la entidad denominada “Socio Liquidador” por medio de la cual se liquidará la operación, en la cámara de compensación a que se refiere el campo 47, 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 dichos socios liquidadores, en este campo se deberá anotar la clave “077000” (equivalente a no aplica).

47. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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).

48. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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 actúe como 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 equivalente al 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”.

49. 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. Sin embargo, las instituciones podrán utilizar este campo como identificador de los cambios internos en la operación, por lo que el campo “número de identificación de la operación” no se deberá modificar.

50. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar un número para identificar cada operación o contrato individual, 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. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

51. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea una operación derivada, en este campo se deberá reportar el mismo “número de identificación” de la operación derivada que se haya informado en el formulario “OPTO” o al formulario relativo a operaciones de derivados de crédito, según corresponda.

Tratándose de operaciones cuyo subyacente no sea una operación derivada, este campo deberá reportarse “vacío”.

52. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

53. 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.

Sección IV Complemento (Swaps sobre subyacentes distintos a tasas de interés)

Este complemento debe enviarse para cada operación o contrato en los que al menos uno de sus “parámetros principales”, a recibir y/o entregar, se modifique en algún momento de su vigencia. De ser el caso, deberá enviarse el detalle de todos y cada uno de los flujos que comprendan dicha operación. En el caso que para una operación determinada, el número de flujos a recibir sea diferente del número de flujos a entregar, el número total de registros que se reporte debe corresponder al número de flujos (ya sea a recibir o entregar) que sea mayor; adicionalmente el (o los) “parámetro(s) principal(es)” que se modifiquen deben reportarse precisamente respecto de dichos flujos (a recibir o entregar, el que sea mayor). 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 IV para la operación correspondiente.

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

Se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, si la institución lleva a cabo Operaciones Derivadas con cualquiera de las contrapartes indicadas en los incisos “a” y “b” del numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. En cualquier otro caso, se deberá anotar la clave de la contraparte vigente de la operación conforma al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo “B”. Asimismo, se deberá anotar la misma clave de contraparte (conforme al Anexo B) que la reportada en el campo “3” de la Sección III para la operación correspondiente.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

3. FECHA DE CONCERTACIÓN.

Se deberá anotar la misma fecha de concertación que la reportada en el campo “3” de la Sección IV para la operación correspondiente (con formato AAAA/MM/DD).

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el mismo número de identificación que el reportado en el campo “50” de la Sección IV para la operación correspondiente. El número de identificación reportado a Banco de México no podrá ser modificado.

5. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a recibir de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 3) y número de identificación (campo 4).

6. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el importe base para el cálculo de los flujos a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno los flujos a recibir 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.

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a recibir de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

9. SUBYACENTE A RECIBIR.

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el subyacente a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el subyacente que se recibirá (conforme al Anexo F) en cada uno los flujos 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el título de deuda, acción, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar la clave del título de deuda o acción que se recibirá (conforme al Anexo AF) en cada uno de los flujos 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.

11. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el número de subyacentes a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el número de subyacentes que se recibirá en cada uno de los flujos 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.

12. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la forma de calcular los flujos a recibir estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar, la clave de la forma de calcular los flujos a recibir que aplicará para cada uno de los flujos 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. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el precio del subyacente a recibir estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el precio del subyacente que aplicará en cada uno de los flujos 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.

14. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, 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 flujos a entregar de la operación de que se trate. Un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más registros (flujos) que tengan la misma fecha de concertación (campo 3) y número de identificación (campo 4).

15. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el importe base para el cálculo de los flujos a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el “importe base” que aplicará para cada uno de los flujos a entregar 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

16. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de inicio de cada flujo a entregar de la operación de que se trate, con formato AAAA/MM/DD.

17. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento (en la que termina el último periodo de cálculo de intereses) del último flujo a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Sin embargo, la fecha registrada deberá estar acorde con la clave reportada en el campo 12, “Acuerdo de Días Inhábiles para el Cálculo de los Flujos”, en la que termina el último periodo de cálculo de intereses.

18. SUBYACENTE A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el subyacente a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el subyacente que se entregará (conforme al Anexo F) en cada uno los flujos 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.

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

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el título de deuda, acción, índice accionario, tasa de interés o tipo de cambio a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar la clave del título de deuda o acción que se entregará (conforme al Anexo AF) en cada uno los flujos 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.

20. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el número de subyacentes a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el número de subyacentes que se entregará en cada uno de los flujos 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.

21. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, la forma de calcular los flujos a entregar estará sujeta a revisión, en este campo se deberá anotar, la clave de la forma de calcular los flujos a entregar que aplicará para cada uno los flujos 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.

22. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Tratándose de swaps cuyo contrato establezca que durante la vigencia de la operación, el precio del subyacente a entregar estará sujeto a revisión, en este campo se deberá anotar el precio del subyacente que aplicará en cada uno de los flujos 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.

23. 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.

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

Se deberá anotar el Identificador Único de Transacción conforme a 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 IV del formulario SWAPS.

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.

Sección V.- Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos, de operaciones celebradas en mercados tanto reconocidos como no reconocidos

1. CLAVE DE LA 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. ORIGEN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar:

- P** Cuando se trate del vencimiento anticipado (o cesión de derechos) de una operación celebrada por cuenta propia (aplica para las Secciones I, II, III y IV).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

T Cuando se trate del vencimiento anticipado (o cesión de derechos) de una operación celebrada por cuenta de una tercera persona (persona cliente). Esta clave aplica exclusivamente para las operaciones de la Sección I.

3. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

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 es por cuenta propia, deberá registrarse el Código LEI de la institución. Sin embargo, para la información con fecha de vencimiento anticipado anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación (original), con formato AAAA/MM/DD. Este campo aplica exclusivamente para las operaciones de las secciones II, III o IV; por tanto, se debe dejar vacío en el caso de operaciones de la Sección I.

5. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave de la sección (1, 2, 3 o 4) que corresponda a la operación original que haya sido vencida o cedida.

6. FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO

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

7. 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”.

8. IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO TOTAL O CESIÓN DE DERECHOS

En el caso de operaciones de las Secciones I y II, se deberá anotar el importe (cuota o “fee” por vencimiento anticipado) efectivamente pagado o recibido por el vencimiento anticipado total, 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 de las Secciones III y IV, se deberá anotar: i) el importe o cuota (“fee”) efectivamente recibido (en la fecha señalada en el campo 6) por concepto del vencimiento anticipado en forma total (“VT” en el campo 15), y en su caso, ii) el importe efectivamente recibido (en la fecha señalada en el campo 6) por concepto del intercambio de importes base establecidos en el contrato correspondiente. Estos importes se deben reportar en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

En el caso de operaciones de las Secciones I a IV, donde se reporte exclusivamente el importe (cuota o “fee” por vencimiento anticipado) efectivamente pagado o recibido por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos, se deberá anotar la clave de la moneda en la que están denominados cualquiera de éstos, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E.

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

10. IMPORTE ENTREGADO POR VENCIMIENTO ANTICIPADO TOTAL

En el caso de operaciones de las Secciones III y IV, se deberá anotar: i) el importe o cuota (“fee”) efectivamente pagado (en la fecha señalada en el campo 6) por concepto del vencimiento anticipado en forma total (“VT” en el campo 15), y en su caso, ii) el importe efectivamente pagado (en la fecha señalada en el campo 6) por concepto del intercambio de importes base establecidos en el contrato correspondiente. Estos importes se deben reportar en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación a entregar establecida en el contrato respectivo.

En el caso de vencimientos anticipados totales de operaciones de las Secciones I y II, así como de cesiones de derechos, o de extinción de operaciones que contemplen la terminación anticipada, se debe anotar “0” (cero) en este campo.

11. IMPORTE A RECIBIR QUE VENDE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL

En su caso, se deberá anotar el importe a recibir (para secciones III y IV), o el importe de referencia (para secciones I y II), que se haya vencido anticipadamente (en la fecha señalada en el campo 6) en forma parcial (“VP” en el campo 15) de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

El importe de uno o varios vencimientos anticipados parciales para una misma operación, deberán ser menores al importe a recibir (para Secciones III y IV), o el importe de referencia (para Secciones I y II).

Cuando exista para una misma operación, uno o más vencimientos anticipados parciales y se requiera vencer anticipadamente el saldo de la operación, éste último se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 15).

El importe que se reporte en este campo debe estar expresado en la misma moneda que la del importe base reportado en la fecha de concertación de la operación que corresponda (ya sea en el campo 14 de la Sección II, o en el campo 15 de las Secciones III y IV).

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

12. IMPORTE A ENTREGAR QUE VENDE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo aplica exclusivamente a operaciones de las Secciones III y IV, y se deberá anotar el importe a entregar que se haya vencido anticipadamente (en la fecha señalada en el campo 6) en forma parcial (“VP” en el campo 15), de la operación de que se trate, en miles (redondeado sin decimales) de unidades de la moneda de denominación establecida en el contrato respectivo.

El importe de uno o varios vencimientos anticipados parciales para una misma operación, deberán ser menores al importe a entregar.

Cuando exista para una misma operación, uno o más vencimientos anticipados parciales y se requiera vencer anticipadamente el saldo de la operación, éste último se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 15).

El importe que se reporte en este campo debe estar expresado en la misma moneda que la del importe base reportado en la fecha de concertación de la operación que corresponda (en el campo 17 de las Secciones III y IV).

En el caso de vencimientos anticipados parciales de las Secciones I y II, o de vencimiento totales de cualquier sección, así como de cesiones de derechos o de operaciones que contemplen la terminación (o extinción); se debe anotar “0” (cero) en este campo.

13. LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar:

- R** Para el caso de las Secciones I y II, cuando la institución haya efectivamente recibido sólo el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos. Para el caso de las Secciones III y IV, cuando la institución haya efectivamente recibido el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total más en su caso, el importe efectivamente recibido por concepto del intercambio de importes base establecidos en el contrato correspondiente.
- P** Para el caso de las Secciones I y II, cuando la institución haya efectivamente pagado sólo el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total, o cesión de derechos. Para el caso de las Secciones III y IV, cuando la Institución haya efectivamente pagado el importe (cuota o “fee”) por vencimiento anticipado total más en su caso, el importe efectivamente pagado por concepto del intercambio de importes base establecidos en el contrato correspondiente.
- N** Cuando la institución no haya recibido ni pagado el importe (cuota o “fee”) por la terminación (o extinción) o vencimiento (total o parcial) anticipado de la operación reportada en las secciones I a IV. Asimismo, en caso que la institución haya recibido y entregado (simultáneamente) los importes por vencimientos anticipados (parciales o totales) por concepto del intercambio de importes base establecidos en el contrato correspondiente para las secciones III y IV.

14. MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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.

15. INDICADOR DE VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Se deberá anotar:

- VT** Cuando la operación se haya vencido (o terminado) anticipadamente en forma total.
- VP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial.
- CD** Cuando los derechos de la operación se hayan cedido.
- EX** Cuando la operación se haya terminado o extinguido anticipadamente.
- CP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente por compactación de portafolio sólo de uno de los participantes.
- OP** Cuando la operación se haya vencido anticipadamente en forma parcial por compactación de portafolio sólo de uno de los participantes.

En caso que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en este campo), debido a la renegociación o reestructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 14), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación, en la sección que corresponda (II, III o IV); considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de renegociación, reestructura, o vencimiento anticipado parcial.

En caso de compactaciones de portafolios en donde una o algunas operaciones sustituyan a éste, y donde la contraparte sea un mercado reconocido, se deberán reportar en la sección que corresponda (II, III o IV); considerando que la fecha de concertación debe ser la misma que la fecha de compactación y reportando la clave de contraparte “246091”.

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 14.

16. 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 dicha operación a Banco de México en las Secciones II, III o IV. En el caso de operaciones de la Sección I este campo se debe dejar vacío.

17. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN

En caso que una determinada operación fuera vencida en forma total (“VT” en el campo 15), debido a la renegociación o reestructuración de alguno o varios de sus términos o condiciones (clave “7” en el campo 14), todas las nuevas características deben informarse a Banco de México como una nueva operación, en la sección que corresponda (II, III o IV); 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

clave alfanumérica) de dicha nueva operación, tal cual fue informada al Banco de México en la sección que corresponda (II, III o IV).

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”.

18. 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.

19. 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, III o IV del formulario de SWAPS. Adicionalmente, si la operación corresponde a la Sección I, este campo deberá reportarse “vacío”.

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

20. IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN NUEVO

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

Para los vencimientos anticipados, parciales o totales, distintos a los mencionados anteriormente, este campo debe reportarse “vacío”. Si la operación corresponde a la Sección I, este campo deberá 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección VI.- Intercambios de importe base, o pago o recepción de cuota compensatoria, para las operaciones 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. FECHA DE CONCERTACIÓN

Se deberá anotar la fecha de concertación de la operación, con formato AAAA/MM/DD. Esta fecha debe ser la misma con la que se envió la operación correspondiente en las secciones 2, 3 o 4.

3. INDICADOR DE INTERCAMBIO DE IMPORTE BASE O CUOTA COMPENSATORIA

Se deberá anotar:

- I Cuando el registro a reportar corresponda a un intercambio de importe (ya sea a recibir y/o entregar). Esta clave se utilizará para las secciones 2, 3 y 4.
- C Cuando el registro a reportar corresponda a una cuota compensatoria (ya sea a recibir y/o entregar). Esta clave aplica para las secciones 2, 3 y 4.

4. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave de la sección (2, 3 o 4) que corresponda a la operación con pago de cuota compensatoria, y/o con intercambio de importes base.

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el número (o clave alfanumérica) de la operación con intercambio de importe base a reportar. Este número (o clave) debe ser el mismo con el que se envió la operación correspondiente en las secciones 2, 3 o 4.

6. FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A RECIBIR

Se deberá reportar la fecha, con formato AAAA/MM/DD, en la que se realizarán las liquidaciones de los importes base, o cuota compensatoria, a recibir, conforme al calendario establecido en el contrato de la operación a reportar. En el caso de operaciones que contemplen únicamente entrega de cuota compensatoria, este campo debe reportarse “vacío”.

7. IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE RECIBE, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá reportar el importe base o cuota compensatoria, a recibir, en miles de unidades de la moneda que corresponda, conforme al calendario establecido en el contrato de la operación a reportar. En el caso de operaciones que contemplen únicamente entrega de cuota compensatoria, en este campo se debe reportar “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

8. MONEDA DEL IMPORTE QUE SE RECIBE

Se deberá anotar la clave que corresponda (según el contrato) a la moneda en que esté denominado el importe base o cuota compensatoria, a recibir de la operación (campo 7), conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E. En el caso de operaciones que contemplen únicamente entrega de cuota compensatoria, en este campo se debe reportar “0” (cero), equivalente a no aplica.

9. FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A ENTREGAR

Se deberá reportar la fecha, con formato AAAA/MM/DD, en la que se realizarán las liquidaciones de los importes base o cuota compensatoria, a entregar, conforme al calendario establecido en el contrato de la operación a reportar. En el caso de operaciones que contemplen únicamente la recepción de cuota compensatoria, este campo debe reportarse “vacío”.

10. IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE ENTREGA, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN

Se deberá reportar el importe base o cuota compensatoria, a entregar, en miles de unidades de la moneda que corresponda, conforme al calendario establecido en el contrato de la operación a reportar. En el caso de operaciones que contemplen únicamente la recepción de cuota compensatoria, en este campo se debe reportar “0” (cero).

11. MONEDA DEL IMPORTE QUE SE ENTREGA

Se deberá anotar la clave que corresponda a la moneda en que esté denominado (conforme al contrato correspondiente) el importe base, o cuota compensatoria (campo 10), a entregar de la operación de que se trate, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E. En el caso de operaciones que contemplen únicamente la recepción de cuota compensatoria, en este campo se debe reportar “0” (cero), equivalente a no aplica.

12. NÚMERO SECUENCIAL DEL REGISTRO PARA IDENTIFICAR EL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE (O CUOTA COMPENSATORIA)

Se deberá anotar un número secuencial, consecutivo, entero, iniciando con el número uno (1), con el cual se identificarán cada uno de los intercambios de importe base (o cuota compensatoria); sobre la base que un mismo número secuencial no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2) y número de identificación de la operación (campo 5). En el caso de operaciones que contemplen la recepción, o la entrega, de una sola cuota compensatoria (o importe base), en este campo se debe reportar “1”.

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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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, III o IV del formulario SWAPS.

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.

Sección VII.- Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebrada 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. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo se refiere a la fecha de concertación de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 4).

3. ORIGEN DE LA POSICIÓN

Este campo se refiere al origen de la operación vigente a la fecha de corte a confirmar, y mostrará:

- P** Cuando se trate de una operación por cuenta propia.
- T** Cuando se trate de una operación 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 de la Sección I), en este campo 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 es por cuenta propia, deberá registrarse el Código LEI de la institución.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

5. FECHA DE CORTE

Este campo se refiere a la fecha de corte que corresponda a la operación vigente a confirmar, sobre una determinada pizarra y con un mismo socio liquidador.

6. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación vigente a confirmar, a la fecha de corte (campo 4).

7. PIZARRA DE LA OPERACIÓN

Este campo tendrá:

- 1 Cuando la operación vigente (a la fecha del campo 4), para la pizarra y socio liquidador respectivos, se refiere a una que intercambia tasa fija por tasa variable.
- 2 Cuando la operación vigente (a la fecha del campo 4), para la pizarra y socio liquidador respectivos, se refiere a una que intercambia tasa variable por tasa variable.
- 3 Cuando la operación vigente (a la fecha del campo 4), para la pizarra y socio liquidador respectivos, se refiere a una que intercambia tasa fija por tasa fija.

8. CLAVE DE PIZARRA

Este campo se refiere a la “clave de pizarra” de la operación vigente a confirmar, con la entidad denominada socio liquidador a que se refiere el campo 7.

9. SOCIO LIQUIDADOR

Este campo se refiere a la clave de la entidad denominada socio liquidador que corresponda a la operación vigente a confirmar, para la “clave de pizarra” a que se refiere el campo 6.

10. NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES EN LA OPERACIÓN

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

11. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el objetivo que corresponda a la operación vigente a confirmar en la fecha de corte (campo 4), conforme al “Catálogo de Objetivo de la Operación” a que se refiere el Anexo D.

12. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte activa de la posición vigente. Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

13. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte pasiva de la posición vigente. Dicho valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

14. DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de una posición vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente implique recibir una tasa de interés fija (campo 5 igual a “1” o “3”), se podrá anotar la “Duración” correspondiente a la parte activa de la posición vigente, calculada conforme a lo señalado en el “Anexo 1-N” de la Circular Única de Bancos de la CNBV (o en el Anexo “2” de la Circular Única de Casas de Bolsa de la CNBV), y expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de posiciones vigentes que reciben una tasa de interés variable (campo 5 igual a “1” o “2”), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

15. DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de una operación vigente, sobre una pizarra cuyo subyacente implique entregar una tasa de interés fija (campo 5 igual a “1” o “3”), se podrá anotar la “Duración” correspondiente a la parte pasiva de la posición vigente, calculada conforme a lo señalado en el “Anexo 1-N” de la Circular Única de Bancos de la CNBV (o en el Anexo “2” de la Circular Única de Casas de Bolsa de la CNBV), y expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de operaciones vigentes que entreguen una tasa de interés variable (campo 5 igual a “1” o “2”), en este campo deberá reportarse “0” (cero).

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

Se deberá anotar la clave o folio de identificación del contrato de garantía relativo a la operación vigente confirmar. Cabe recordar que un mismo contrato de garantía puede estar relacionado con dos o más operaciones. Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la Sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

17. 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección VIII.- Información de la convalidación de operaciones 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 4).

3. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere a la clave de la sección (2, 3 o 4) que corresponde a la operación vigente a confirmar, a la fecha de corte (campo 4).

4. FECHA DE CORTE

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

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo se refiere al número (o clave alfanumérica) de identificación de la operación vigente a confirmar, a la fecha de corte (campo 4).

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A RECIBIR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento del flujo vigente (a la fecha de corte) a recibir de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

7. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A ENTREGAR

Se deberá anotar la fecha de vencimiento del flujo vigente (a la fecha de corte) a entregar de la operación, con formato AAAA/MM/DD.

8. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

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

9. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte activa de la operación (el valor presente de todos los flujos a recibir y, en su caso, el valor presente de cualquier intercambio de importes base a recibir) siempre que dicha parte activa este denominada en la misma moneda que el *importe base que sirve de referencia para los flujos a recibir*. El valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

En caso que para una operación en particular, el valor razonable correspondiente a los campos 9 u 11 resulte negativo las Instituciones deberán solicitar al Banco de México la apertura de la validación del sistema de acopio para el envío de dichas valuaciones. La solicitud deberá realizarse a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx, indicando el periodo y una breve explicación de razones por las que resultaron dichas valuaciones.

10. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

En su caso, debe anotarse el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte activa de la operación (el valor presente de cualquier intercambio de importes base a recibir), vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 4); siempre que dicha parte activa este denominada en la misma moneda que el *importe base que sirve de referencia para los flujos a entregar* (en particular, este campo aplica para los “*Forward starting swaps*” con 2 o más intercambios de importe base pendientes de liquidar). El valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV). En caso que todos los flujos a recibir (incluyendo, en su caso, los intercambios de importes base a recibir) estén denominados en la misma moneda que el importe base que sirve de referencia para los flujos a recibir, en este campo se debe reportar “0” (cero).

11. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

Se deberá anotar el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte pasiva de la operación (el valor presente de todos los flujos a entregar y, en su caso, el valor presente de cualquier intercambio de importes base a entregar), vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 4); siempre que dicha parte pasiva este denominada en la misma moneda que el *importe base que sirve de referencia para los flujos a entregar*. El valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV).

En caso que para una operación en particular, el valor razonable correspondiente a los campos 9 u 11 resulte negativo las Instituciones deberán solicitar al Banco de México la apertura de la validación del sistema de acopio para el envío de dichas valuaciones. La solicitud deberá realizarse a través de un correo electrónico a la dirección derivados@banxico.org.mx, indicando el periodo y una breve explicación de razones por las que resultaron dichas valuaciones.

12. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

En su caso, debe anotarse el valor razonable (expresado en miles de pesos mexicanos, redondeado sin decimales) de la parte pasiva de la operación (el valor presente de cualquier intercambio de importes base a entregar), vigente a la fecha de corte a confirmar (campo 4);

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

siempre que dicha parte pasiva este denominada en la misma moneda que el *importe base que sirve de referencia para los flujos a recibir* (en particular, este campo aplica para los “*Forward starting swaps*” con 2 o más intercambios de importe base pendientes de liquidar). El valor razonable debe determinarse conforme a los criterios contables vigentes establecidos por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (CNBV). En caso que todos los flujos a entregar (incluyendo, en su caso, los intercambios de importes base a entregar) estén denominados en la misma moneda que el importe base que sirve de referencia para los flujos a entregar, en este campo se debe reportar “0” (cero).

13. DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de operaciones que reciben una tasa de interés fija, se deberá anotar la “Duración” correspondiente a la parte activa de la operación, calculada conforme a lo señalado en el “Anexo 1-N” de la Circular Única de Bancos de la CNBV (o en el “Anexo 2” de la Circular Única de Casas de Bolsa de la CNBV), y expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de operaciones que no reciben una tasa de interés fija, en este campo deberá reportarse “0” (cero).

14. DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Tratándose de operaciones que entreguen una tasa de interés fija, se deberá anotar la “Duración” correspondiente a la parte pasiva de la operación, calculada conforme a lo señalado en el “Anexo 1-N” de la Circular Única de Bancos de la CNBV (o en el Anexo 2 de la Circular Única de Casas de Bolsa de la CNBV), y expresada en número de días naturales (enteros sin decimales).

Tratándose de operaciones que no entreguen una tasa de interés fija, en este campo deberá reportarse “0” (cero).

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

En caso que el contrato relativo a la operación vigente considere el otorgamiento de garantías entre las partes, se deberá anotar la clave o folio de identificación del contrato de garantía relativo a la operación vigente de que se trate (identificada en el campo 4). Dicha clave o folio deberá ser el mismo que se informó en la Sección II del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas”.

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

16. 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.

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

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, III o IV del formulario SWAPS.

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Validaciones de negocio que se realizan en SAIF WEB para cada campo del formulario

Sección I.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados 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 Catálogo A. 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 aceptará únicamente las claves “P” o “T”, según sea el caso.

4. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

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”.

Se deberá verificar la obligatoriedad y vigencia del Código LEI registrado en este campo. Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

Adicionalmente, si el campo 3 es igual a “P”, y para la información a partir del primero de junio de 2018, la clave de este campo debe ser la misma que la del campo LEI de la institución. En caso que el campo 3 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo LEI de la institución. Cuando la persona cliente no tenga un Código LEI se deberá reportar la clave Banxico de seis caracteres.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Asimismo, el Código LEI reportado en este campo no deberá corresponder a bancos múltiples, bancos de desarrollo, casas de bolsa y Sofomes-ER.

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 y en dicho catálogo tener el valor de “1” en la columna “swaps1”.

6. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente esta fecha debe ser mayor o igual a la fecha de la columna “fe_ini” y menor o igual a la fecha de la columna “fe_ven”, conforme a las columnas respectivas del Catálogo Pizarra AA, que correspondan a la pizarra registrada en el campo 8.

7. POSICIÓN EN LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “1”, “2” o “3”, según sea el caso.

8. CLAVE DE PIZARRA

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave de “pizarra” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Catálogo Pizarra AA. Asimismo, el mercado asociado a la pizarra (columna “mdo” del Catálogo AA) debe ser idéntico al registrado en el campo 5. Adicionalmente, la columna “swaps1” del Anexo AA, que corresponda a la clave de pizarra de este campo, debe ser igual a “1”.

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.

11. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que se reciba una tasa fija (campo “7-Posición en la Operación” igual a “1” o “3”, el valor numérico debe ser igual o mayor que cero y menor que quince. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso 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”.

Tratándose de operaciones que reciban una tasa variable (Clave “2” en el campo “7-Posición en la Operación”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

12. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que se entregue una tasa fija (campo “7-Posición en la Operación” igual a “1” o “3”, el valor numérico debe ser igual o mayor que cero y menor que quince. Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor

Uso Público

Información de acceso público.

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”.

Tratándose de operaciones que entregue una tasa variable (Clave “2” en el campo “7-Posición en la Operación”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

13. 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 6).

14. SOCIO LIQUIDADOR DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Socios Liquidadores de Operaciones Derivadas” a que se refiere el Anexo O. El valor contenido en este campo deberá de ser diferente a “077000”.

15. OPERADOR DE LA OPERACIÓN

Se deberá anotar la clave de “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.

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

16. CÁMARA DE COMPENSACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Cámaras de Compensación” o “Contraparte Central” a que se refiere el Anexo L. El valor de este campo debe ser diferente de “90” asimismo la columna “mercado” del Anexo “L” debe ser diferente de “TR”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección II.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre tasas de interés y con un importe base de referencia (“Interest Rate Swaps”)

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 numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. Adicionalmente, la clave o Código LEI vigente de “Contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B, y debe ser distinta a la clave reportada en el campo 1.

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

025008	ASIGNA COMPENSACION Y LIQUIDACION
213474	ASIGNA COMPENSACION Y LIQ F30430
214831	CHICAGO BOARD OF TRADE
214832	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD. Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD, y puede corresponder a un día inhábil bancario.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse 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 (campo 5). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_recib} - (Fe_{ini_recib} + Nu_{flu_recib} * Int_{flu_recib})| \leq \text{al campo 18}$$

Donde:

Fe_ven_recib es el valor de este campo,

Fe_ini_recib es el valor del campo 5,

Nu_flu_recib es el valor del campo 16,

Int_flu_recib es el valor del campo 18 del registro.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse 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 entregar (campo 7). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_ent} - (Fe_{ini_ent} + Nu_{flu_ent} * Int_{flu_ent})| \leq \text{al campo 19}$$

Donde:

Fe_ven_ent es el valor de este campo,

Fe_ini_ent es el valor del campo 7,

Nu_flu_ent es el valor del campo 17,

Int_flu_ent es el valor del campo 19 del registro.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, el valor de este campo debe estar comprendido en el Anexo “C”, y tener “1” (uno) en la columna “swaps2”.

10. 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.

11. REVISIÓN DE LOS PARÁMETROS DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap” a que se refiere el Anexo H.

Tratándose de operaciones en las que no se establezca revisión de parámetros, se deberá anotar “Sin Revisión de Parámetros” (clave “SINRP” en el Anexo H).

En caso que este campo sea igual a “SINRP”, la operación correspondiente no debe reportarse en el “Complemento” de esta sección. Si este campo es distinto de “SINRP”, entonces la operación correspondiente debe reportarse en el “Complemento” de esta sección.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

Este campo no podrá reportarse vacío. 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.

13. IMPORTE BASE DEL CONTRATO

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

14. MONEDA DEL IMPORTE BASE

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

Si el valor del campo 46 (“CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS.”) es igual a 1, la moneda en este campo debe de ser “484”.

15. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

Este campo no podrá reportarse vacío y su valor deberá ser mayor o igual a cero.

Si este campo es mayor o igual que “7” se enviará el diagnóstico no grave “Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en este campo”.

16. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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”.

17. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

(o diagnóstico no grave): “Favor de confirmar el número de flujos a entregar con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

18. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

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

Adicionalmente, si el campo 16 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días de los campos 6 y 5.

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 este campo”.

19. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

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

Adicionalmente, si el campo 17 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días de los campos 8 y 7.

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 este campo”.

20. TIPO DE TASA A RECIBIR

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

Cuando en el campo 46 (“CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS.”) se reporte el valor de “1” únicamente se aceptarán las claves “TIM” o “TIF”.

Adicionalmente, cuando el campo 14 sea igual a “484”, en este campo sólo podrá reportarse “TIM” o “TIF”.

21. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

22. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA” y 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, verificando que la clave de la columna “Tipo de Subyacente”, de este

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

catálogo, sea igual a la clave del campo 20 (es decir, que el tipo de subyacente que corresponda a la clave de tasa de referencia reportado, sea el mismo que el campo 20, “Tipo de Tasa a Recibir”). Adicionalmente, la correspondiente “mda_suby” del Anexo AF debe ser la misma que el campo 14 (“MONEDA DEL IMPORTE BASE”).

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

Cuando el campo 46 (“Cámara de Compensación o Repositorio de Derivados.”) sea igual a “1” y el campo 20 sea igual a “TIM”, el valor de este campo deberá ser igual “MXIBTIIE”.

23. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno y menor o igual que el campo 18.

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Si el campo 25 es igual a “S01” lo reportado en este campo deberá de ser igual al campo 18. Si la clave del campo 25 es igual a “S01”, el valor de este campo deberá corresponder al plazo de la tasa indicada en el campo 22, “Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”.

24. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (RECIBIR)

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

25. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

26. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX” su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3).

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

27. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

En caso que el campo 28 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Recibir”) sea mayor que “0” (cero), entonces este campo debe tener exclusivamente uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 28 es igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío.

28. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 20 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

29. TIPO DE TASA A ENTREGAR

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

Cuando en el campo 46 (“CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS.”) se reporte el valor de “1” únicamente se aceptarán las claves “TIM” o “TIF”.

Adicionalmente, cuando el campo 14 sea igual a “484”, en este campo sólo podrá reportarse “TIM” o “TIF”.

30. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

31. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y estar comprendida en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Tasa de Interés y Tipo de Cambio”, a que se

Uso Público

Información de acceso público.

refiere el Anexo AF, verificando que la clave de la columna “Tipo de Subyacente”, de este catálogo, sea igual a la clave del campo 29 (es decir, que el tipo de subyacente que corresponda a la clave de tasa de referencia reportado, sea el mismo que el campo 29, “Tipo de Tasa a Entregar”). Adicionalmente, la correspondiente “mda_suby” del Anexo AF debe ser la misma que el campo 14 (“MONEDA DEL IMPORTE BASE”).

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

En caso que el campo 22 (“Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”) sea distinto de “NA”, la clave de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 22.

Cuando en el campo 46 (“Cámara de Compensación o Repositorio de Derivados.”) sea igual a “1” y el campo 29 sea igual a “TIM”, el valor de este campo deberá ser igual a “MXIBTIE”.

32. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno y menor o igual que el campo 19.

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Si el campo 34 es igual a “S01” lo reportado en este campo deberá de ser igual al campo 19. Si la clave del campo 34 es igual a “S01”, el valor de este campo deberá corresponder al plazo de la tasa indicada en el campo 31, “Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Entregar”.

33. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (ENTREGAR)

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

34. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

35. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX” su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

36. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 37 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Entregar”) sea mayor que “0” (cero), entonces este campo debe tener exclusivamente uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 37 es igual a “0”, entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío.

37. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 29 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

38. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Anexo X.

39. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “P” o “T”.

40. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “M”, “C” o “N”.

41. 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 “swaps2”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando la clave del campo 41 sea distinta de “90”, se debe registrar una clave alfanumérica distinta de “NA”.

En caso que el campo 41 sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

Uso Público

Información de acceso público.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, cuando el campo 41 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 42. 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 42).

En caso que el campo 41 sea igual a “90” (y el campo 42 igual a “NA”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

44. PLATAFORMA DE NEGOCIACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Plataformas de Negociación” a que se refiere el Anexo K.

45. 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.

Si el campo 46 es igual a “90” o el campo “mercado” en el Anexo “L” es igual a “TR”, el valor reportado en este campo deberá ser igual a “077000”.

Si el campo “46” es igual a “1”, este campo no deberá de ser igual a “077000”.

46. 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.

Adicionalmente, si el campo 45 es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual a “90”. Sin embargo, si la clave reportada en este campo es diferente de “90”, esta clave en el campo “mercado” del Anexo L le debe corresponder el valor de “TR”.

47. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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

48. CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío.

49. 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 4).

50. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

En caso que el campo 41 sea igual a “6”, este campo no puede reportarse vacío.

Si el campo 41 es distinto de “6”, este campo debe reportarse vacío.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1 (“Clave de la institución”).

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

52. 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 (“Interest Rate Swaps”)

VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO. Los registros enviados por cada institución en la Sección II, para una determinada fecha de concertación, que en el campo 11 (Revisión de los Parámetros de la Operación) sean igual a “SINRP”, NO deberán reportarse en esta sección. Por tanto, los registros que en la Sección II tengan el campo 11 distinto de “SINRP”, 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 49).

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

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, esta fecha es uno de los tres campos "llave" para relacionar los registros de este "Complemento" con los correspondientes de la Sección II.

5. IMPORTE BASE DEL FLUJO

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, su valor numérico debe ser mayor o igual que uno. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11 ("Revisión de los Parámetros de la Operación") del registro de la Sección II con los mismos campos "llave" que el registro de este "Complemento" sea igual a "00ENT", "00REC" o "00RYE".

6. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros. El valor del último registro debe ser igual al valor del campo 16 ("Número total de flujos a recibir del Swap") de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos "llave".

Adicionalmente, si el campo "15-Número del Flujo a Entregar" es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe contener el formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su primer registro (que tenga el campo “6-Número de flujo a recibir” igual a “1”), debe ser igual al campo 5 (“Fecha de inicio del primer flujo a recibir”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “6- Número del Flujo a Recibir” no es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe contener el formato AAAA/MM/DD y, en su caso podrá ser día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su último registro, debe ser igual al campo 6 (“Fecha de vencimiento del último flujo a recibir del Swap”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “6- Número del Flujo a Recibir” no es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío.

9. TIPO DE TASA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, debe ser igual exclusivamente a alguna de las claves siguientes: “TIM”, TIX” o “TIF”. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) del registro de la sección II con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBENT” o “000ENT”.

10. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

11. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y 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, verificando que la clave de la columna “Suby” sea igual a la clave del campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Cuando el campo 9 sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

12. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 13 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Recibir”) sea mayor que “0” (cero), este campo debe ser igual a uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 13 es vacío o igual a “0”, entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

13. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

14. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es vacío, este campo debe ser igual a “NA”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

15. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros. El número del último registro debe ser igual al valor del campo 17 (“Número Total de Flujos a entregar del Swap”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “6-Número del Flujo a Recibir” es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

16. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe contener el formato AAAA/MM/DD y en su caso podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su primer registro (que tenga el campo “15-Número del flujo a entregar” igual a “1”), debe ser igual al campo 7 (“Fecha de inicio del primer flujo a entregar”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “15-Número de Flujo a Entregar” es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío.

17. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe contener el formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su último registro, debe ser igual al campo 17 (“Número total de flujos a entregar del Swap”) de la Sección II, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “15-Número de Flujo a Entregar” es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío.

18. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, debe ser igual exclusivamente a alguna de las claves siguientes: “TIM”, “TIX” o “TIF”. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) del registro de la Sección II con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBREC” o “000REC”.

En caso que el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual “TIF”, este campo debe ser igual a “TIM” o “TIX”.

19. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

20. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR**Uso Público**

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo podrá reportarse vacío. Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y 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, verificando que la clave de la columna “Suby” sea igual a la clave del campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”).

Cuando el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”. Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

En caso que el campo 11 (“Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”) sea distinto de “NA” o vacío, la clave de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 11.

21. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 22 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de Referencia a Entregar”) sea mayor que “0” (cero), entonces este campo debe ser igual exclusivamente a uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 22 es vacío o igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío. Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

22. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser y menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

23. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Si el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es vacío, este campo debe ser igual a “NA”.

Cuando el campo 18 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

Uso Público

Información de acceso público.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

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

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

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

Sección III.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos, sobre tasas de interés y con dos importes base de referencia (“Cross Currency Swaps”)

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”), casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”) o 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 numeral 4 de la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. Adicionalmente, la clave o Código LEI vigente de “Contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B, y debe ser distinta a la clave reportada en el campo 1.

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

025008	ASIGNA COMPENSACION Y LIQUIDACION
213474	ASIGNA COMPENSACION Y LIQ F30430
214831	CHICAGO BOARD OF TRADE
214832	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, la fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD. Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD, y puede corresponder a un día inhábil bancario.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse 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 (campo 5). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_recib} - (Fe_{ini_recib} + Nu_{flu_recib} * Int_{flu_recib})| \leq \text{al campo 21}$$

Donde:

Fe_{ven_recib} es el valor de este campo,

Fe_{ini_recib} es el valor del campo 5,

Nu_{flu_recib} es el valor del campo 19,

Int_{flu_recib} es el valor del campo 21 del registro.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá contener el formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse 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 entregar (campo 7). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_ent} - (Fe_{ini_ent} + Nu_{flu_ent} * Int_{flu_ent})| \leq \text{al campo 22}$$

Donde:

Fe_{ven_ent} es el valor de este campo,

Fe_{ini_ent} es el valor del campo 7,

Nu_{flu_ent} es el valor del campo 20,

Int_{flu_ent} es el valor del campo 22 del registro.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, el valor de este campo debe estar comprendido en el Anexo "C", y tener "1" (uno) en la columna "swaps3".

10. 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.

11. REVISIÓN DE LOS PARÁMETROS DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap" a que se refiere el Anexo H.

Tratándose de operaciones en las que no se establezca revisión de parámetros, se deberá anotar "Sin Revisión de Parámetros" (clave "SINRP" en el Anexo H).

En caso que este campo sea igual a "SINRP", la operación correspondiente no debe reportarse en el "Complemento" de esta sección. Si este campo es distinto de "SINRP", entonces la operación correspondiente debe reportarse en el "Complemento" de esta sección.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Convención de Días Inhábiles para las Fechas de Vencimiento de los Flujos del Swap", a que se refiere el Anexo I.

13. MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Modalidades de Intercambio de los Importes Base del Swap", a que se refiere el Anexo Q.

14. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

15. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)

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

16. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA FLUJOS A ENTREGAR

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

17. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)

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

Adicionalmente, la clave de este campo debe ser distinta de la que se reporte en el campo 15, “Moneda del Importe Base (Flujos a Recibir)”.

18. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

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

Si este campo es mayor o igual que “7” se enviará el diagnóstico no grave “Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en este campo”.

19. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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”.

20. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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 entregar con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

21. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

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

Adicionalmente, si el campo 19 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días entre el campo 5 y el campo 6.

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 este campo”.

22. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

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

Adicionalmente, si el campo 19 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días entre el campo 7 y el campo 8.

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 este campo”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

23. TIPO DE TASA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “TIM”, “TIX” “TIF”, según sea el caso.

Adicionalmente, cuando el campo 15 sea igual a “484”, en este campo sólo podrá reportarse “TIM” o “TIF” y cuando el campo 15 sea igual a “979”, en este campo sólo podrá reportarse “TIF”

24. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

25. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y 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, verificando que la clave de la columna “Tipo de Subyacente” sea igual a la clave del campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”).

Adicionalmente, la correspondiente “mda_suby” del Anexo AF debe ser la misma que el campo 15 (“MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)”).

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

Cuando el campo 34 (“TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR”) sea diferente a “NA”, la clave debe ser distinta a la de este campo.

26. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno y menor o igual que el valor del campo 21 “Intervalo del Flujo a Recibir”.

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Si el campo 28 es igual a “S01” lo reportado en este campo deberá de ser igual al campo 21 “Intervalo del Flujo a Recibir”. Si la clave del campo 28 es igual a “S01”, el valor de este campo

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

deberá corresponder al plazo de la tasa indicada en el campo 25, “Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”.

27. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A RECIBIR)

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

28. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “NA”.

29. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3).

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

30. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 31 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Recibir”) sea mayor que “0” (cero), entonces este campo debe tener exclusivamente uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 31 es igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 23 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

32. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

Adicionalmente, cuando el campo 17 sea igual a “484”, en este campo sólo podrá reportarse “TIM” o “TIF” y cuando el campo 17 sea igual a “979”, en este campo sólo podrá reportarse “TIF”.

33. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, 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 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”.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

34. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y 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, verificando que la clave de la columna “Tipo de Subyacente” sea igual a la clave del campo 32 “Tipo de Tasa a Entregar”.

Adicionalmente, la correspondiente “mda_suby” del Anexo AF debe ser la misma que el campo 17 “MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)”.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “NA”.

En caso que el campo 25 (“Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”) sea distinto de “NA”, la clave de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 25.

35. INTERVALO DE REVISIÓN DE LA TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR EL IMPORTE DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor o igual que uno y menor o igual que el valor del campo 22 “Intervalo del Flujo a Entregar”.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

Si el campo 37 es igual a “S01” lo reportado en este campo deberá de ser igual al campo 22 “Intervalo del Flujo a Entregar”. Si la clave del campo 37 es igual a “S01”, el valor de este

Uso Público

Información de acceso público.

campo deberá corresponder al plazo de la tasa indicada en el campo 34, “Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Entregar”.

36. AÑO COMERCIAL O AÑO NATURAL (FLUJOS A ENTREGAR)

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

37. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR.

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “NA”.

38. FACTOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que cero y menor o igual que tres (3).

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

39. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 40 (“Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Entregar”) sea mayor que “0” (cero), entonces este campo debe tener uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 40 es igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío.

40. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 32 (“Tipo de Tasa a Entregar”) sea igual a “TIF”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

41. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Anexo X.

En este campo no deberá reportarse la clave “A”.

42. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “P” o “T”.

43. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “M”, “C” o “N”.

44. 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 “swaps3”.

45. 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 44 sea distinta de “90”, se debe registrar una clave alfanumérica distinta de “NA”.

En caso que el campo 44 sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

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

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, cuando el campo 44 sea distinto de “90”, entonces el valor numérico de este campo 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 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 44).

En caso que el campo 44 sea igual a “90” (y el campo 45 igual a “NA”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

47. 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.

48. 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.

Si el campo 49 es igual a “90” o el campo “mercado” en el Anexo L es igual a “TR”, el valor reportado en este campo deberá ser igual a “077000”.

49. CÁMARA DE COMPENSACIÓN O REPOSITORIO DE DERIVADOS

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 y ser diferente de “1”.

Adicionalmente, si el campo 48 es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual a “90”, si la clave reportada es diferente de “90”, ésta en el campo “mercado” en el anexo “L” deberá ser igual a “TR”.

Si el campo 48 es distinto de “077000”, entonces este campo debe ser distinto de “90”.

50. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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

51. CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío.

52. 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 4).

53. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

En caso que el campo 45 sea igual a “6”, este campo no podrá reportarse vacío.

Si el campo 44 es distinto de “6”, este campo debe reportarse vacío.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo B cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

55. 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 III (“Cross Currency Swaps”)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO. Los registros enviados por cada institución en la sección III, para una determinada fecha de concertación, que en el campo 11 (Revisión de los Parámetros de la Operación) sean igual a “SINRP”, no deberán reportarse en esta sección. Por tanto, los registros que en la Sección III tengan el campo 11 distinto de “SINRP”, 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 III, 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 52).

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE

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

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

025008	ASIGNA COMPENSACION Y LIQUIDACION
213474	ASIGNA COMPENSACION Y LIQ F30430
214831	CHICAGO BOARD OF TRADE
214832	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

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 III.

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 III

5. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros. El valor del último registro debe ser igual al valor del campo 19 (“Número total de flujos a recibir del Swap”) de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo “15-Número del Flujo a Entregar” es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

6. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, entonces su valor numérico debe ser mayor o igual que uno. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) del registro de la Sección III con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “O0ENT”, “O0REC” o “O0RYE”.

Si la clave reportada en el campo 11 (“Revisión de los parámetros de la operación”) del correspondiente registro primario de la Sección III de SWAPS, con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a “IB000”, “IBREC” o “IBRYE”, este campo deberá ser igual al campo 14, “Importe Base del Contrato que sirve de Referencia para Calcular los Flujos a Recibir”, de dicho registro primario de la Sección III, cuando el campo 5, “Número de Flujos a Recibir”, de esta sección sea igual a “1”.

Asimismo, si el campo 11 (“Revisión de los parámetros de la operación”) del correspondiente registro primario de la Sección III de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a la clave “IBENT”, este campo deberá reportarse vacío.

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su primer registro (que tenga el campo 5 “Número de flujo a recibir” igual a “1”), debe ser igual al campo 5, “Fecha de inicio del primer flujo a recibir”, de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 5 “Número del Flujo a Recibir” de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD, y en su caso podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su último registro, debe ser igual al campo 6, “Fecha de vencimiento del último

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

flujo a recibir del Swap”, de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 5, “Número del Flujo a Recibir”, de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

9. TIPO DE TASA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, debe ser igual exclusivamente a alguna de las claves siguientes: “TIM”, “TIX” o “TIF”. Adicionalmente, este campo debe reportarse vacío, cuando el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) del registro de la Sección III con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBENT” o “00ENT”.

10. VALOR DE LA TASA FIJA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 9, “Tipo de Tasa a Recibir”, sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, el valor numérico de este campo debe ser mayor que cero y menor que quince (15). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso 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”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

11. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. Si el campo 9, “Tipo de Tasa a Recibir”, es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y debe 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, verificando que la clave de la columna “Suby” sea igual a la clave del campo 9, “Tipo de Tasa a Recibir”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

12. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 13, “Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a Recibir”, sea mayor que “0” (cero), este campo debe tener exclusivamente uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 13 es igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

13. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

14. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Si el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) es vacío, este campo debe ser igual a “NA”.

Cuando el campo 9 (“Tipo de Tasa a Recibir”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

15. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros. El número del último registro debe ser igual al valor del campo 20, “Número Total de Flujos a entregar del Swap”, de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 5, “Número del Flujo a Recibir” es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

16. IMPORTE BASE PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, entonces su valor numérico debe ser mayor o igual que uno. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11, “Revisión de los Parámetros de la Operación”, del registro de la Sección III con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “00ENT”, “00REC” o “00RYE”.

Si la clave reportada en el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la Sección III de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a “IB000”, “IBENT” o “IBRYE”, este campo deberá ser igual al campo 16, “Importe Base para del Contrato que sirve de Referencia para Calcular los Flujos a Entregar”, de dicho registro primario de la Sección III, cuando el campo 15, “Número de Flujos a Entregar”, de esta sección se igual a “1”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Asimismo, si el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la Sección III de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a la clave “IBREC”, este campo deberá reportarse vacío.

17. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su primer registro (que tenga el campo 15 “Número de flujo a entregar” igual a “1”), debe ser igual al campo 7, “Fecha de inicio del primer flujo a entregar”, de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 15 “Número del Flujo a Entregar” de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

18. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su último registro, debe ser igual al campo 8, “Fecha de vencimiento del último flujo a entregar”, de la Sección III, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 15 “Número del Flujo a Entregar” de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

19. TIPO DE TASA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, debe ser igual exclusivamente a alguna de las claves siguientes: “TIM”, “TIX” o “TIF”. Adicionalmente, este campo debe reportarse vacío, cuando el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) del registro de la Sección III con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBREC” o “00REC”.

20. VALOR DE LA TASA FIJA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 19, “Tipo de Tasa a entregar”, sea igual a “TIF”, este campo no podrá reportarse vacío.

Adicionalmente, el valor numérico de este campo debe ser mayor que cero y menor que quince (15). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso 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”.

Cuando el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

21. TASA DE REFERENCIA PARA DETERMINAR LA TASA VARIABLE A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. Si el campo 19, “Tipo de Tasa a entregar”, es igual a “TIM” o “TIX”, la clave que se anote debe ser distinta de “NA”, y 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, verificando que la clave de la columna “Suby” sea igual a la clave del campo 19, “Tipo de Tasa a entregar”.

Cuando el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”. Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

En caso que el campo 11, “Tasa de Referencia para Determinar la Tasa Variable a Recibir”, sea distinto de “NA” o vacío, el valor de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 11.

22. OPERADOR APLICABLE A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío.

En caso que el campo 23, “Puntos porcentuales aplicables a la Tasa de referencia a entregar”, sea mayor que “0” (cero), este campo debe ser igual exclusivamente a uno de los siguientes signos: “+” (más) o “-” (menos). Si dicho campo 23 es igual a “0” (cero), entonces este campo debe reportarse vacío.

Cuando el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe reportarse vacío. Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

23. PUNTOS PORCENTUALES APLICABLES A LA TASA DE REFERENCIA A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 19, “Tipo de Tasa a entregar”, sea igual a “TIM” o “TIX”, este campo debe ser igual o mayor que cero.

Además de lo anterior, el valor numérico de este campo debe ser y menor o igual que diez (10). Esta validación es de diagnóstico (no grave), y en caso que el valor reportado sea mayor al rango anterior se debe mostrar la siguiente advertencia: “Favor de confirmar los puntos porcentuales con base al contenido de la hoja de términos y condiciones de la operación correspondiente”.

Cuando el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

24. MODALIDAD DE LA TASA DE REFERENCIA, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es igual a “TIM” o “TIX”, 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”.

Si el campo 19 (“Tipo de Tasa a Entregar”) es vacío, este campo debe ser igual a “NA”.

Uso Público

Información de acceso público.

Cuando el campo 19 (“Tipo de Tasa a entregar”) sea igual a “TIF”, este campo debe ser igual a “NA”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo B cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1 (“Clave de la institución”).

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

26. 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 III), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 3) 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 IV.- Operaciones de intercambio de flujos y rendimientos celebradas en mercados no reconocidos sobre subyacentes distintos a tasas de interés

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”), casa de bolsa (campo 1 inicia con “013”), SOFOM-ER (campo 1 inicia con “068”).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 numeral 4 de la Circular 4/2012, deberá anotarse el Código LEI. Adicionalmente, la clave o Código LEI vigente de “Contraparte” que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo B, y debe ser distinta a la clave reportada en el campo 1.

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

025008	ASIGNA COMPENSACION Y LIQUIDACION
213474	ASIGNA COMPENSACION Y LIQ F30430
214831	CHICAGO BOARD OF TRADE
214832	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
214833	LONDON INTERNATIONAL FINANCIAL FUTURES EXCHANGE
214835	NEW YORK STOCK EXCHANGE
214836	MID AMERICA COMMODITY EXCHANGE
214837	CHICAGO BOARD OPTIONS EXCHANGE
214838	COMMODITY EXCHANGE INCORPORATION
214839	ATHENS STOCK EXCHANGE

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

4. FECHA DE CONCERTACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, la fecha que se anote deberá estar en formato AAAA/MM/DD. Esta fecha debe ser un día hábil bancario (ya sea en México o en el extranjero).

5. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá estar en formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario. Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá estar en formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de inicio del primer flujo a recibir (campo 5). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_recib} - (Fe_{ini_recib} + Nu_flu_recib * Int_flu_recib)| \leq \text{al campo 21}$$

Donde:

Fe_{ven_recib} es el valor de este campo,

Fe_{ini_recib} es el valor del campo 5,

Nu_flu_recib es el valor del campo 19,

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Int_flu_recib es el valor del campo 21 del registro.

7. FECHA DE INICIO DEL PRIMER FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá estar en formato AAAA/MM/DD y puede corresponder a un día inhábil bancario.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL ÚLTIMO FLUJO A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. La fecha que se anote deberá estar en formato AAAA/MM/DD. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de inicio del primer flujo a entregar (campo 7). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

La fecha reportada en este campo deberá satisfacer lo siguiente,

$$|Fe_{ven_ent} - (Fe_{ini_ent} + Nu_{flu_ent} * Int_{flu_ent})| \leq \text{al campo 22}$$

Donde:

Fe_ven_ent es el valor de este campo,

Fe_ini_ent es el valor del campo 7,

Nu_flu_ent es el valor del campo 20,

Int_flu_ent es el valor del campo 22 del registro.

9. TIPO DE PRODUCTO DERIVADO

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, el valor de este campo debe estar comprendido en el Anexo C, y tener "1" (uno) en la columna "swaps4".

10. 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.

11. REVISIÓN DE LOS PARÁMETROS DEL "SWAP"

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote deberá estar comprendida en el "Catálogo de Revisión de los Parámetros del Swap" a que se refiere el Anexo H.

Tratándose de operaciones en las que no se establezca revisión de parámetros, se deberá anotar "Sin Revisión de Parámetros" (clave "SINRP" en el Anexo H).

En caso que este campo sea igual a "SINRP", la operación correspondiente no debe reportarse en el "Complemento" de esta sección. Si este campo es distinto de "SINRP", entonces la operación correspondiente debe reportarse en el "Complemento" de esta sección.

12. ACUERDO DE DÍAS INHÁBILES PARA CÁLCULO DE LOS FLUJOS

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote debe estar comprendida en el Catálogo de Convención de Días Inhábiles para las Fechas de Vencimiento de los Flujos del Swap", a que se refiere el Anexo I.

13. MODALIDAD DEL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE

Este campo no podrá reportarse vacío. La clave que se anote debe estar comprendida en el "Catálogo de Modalidades de Intercambio de los Importes Base del Swap", a que se refiere el Anexo Q.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

14. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

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

15. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A RECIBIR)

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

16. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

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

17. MONEDA DEL IMPORTE BASE (FLUJOS A ENTREGAR)

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

18. NÚMERO DE DÍAS HÁBILES PARA LIQUIDAR CADA FLUJO

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

Si este campo es mayor o igual que 7 se enviará el diagnóstico no grave “Favor de validar mediante carta confirmación el dato reportado en este campo”.

19. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A RECIBIR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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”.

20. NÚMERO TOTAL DE FLUJOS A ENTREGAR DEL SWAP

Este campo no podrá reportarse 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”.

21. INTERVALO DEL FLUJO A RECIBIR

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

Adicionalmente, si el campo 19 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días entre el campo 5 y el campo 6.

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 este campo”.

22. INTERVALO DEL FLUJO A ENTREGAR

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

Adicionalmente, si el campo 19 contiene el valor de “1”, el dato reportado en este campo deberá ser igual a la diferencia en días entre el campo 7 y el campo 8.

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 este campo”.

Uso Público

Información de acceso público.

23. TIPO DE LIQUIDACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener “S” o “D”, según sea el caso.

24. MONEDA DE LIQUIDACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 23 sea igual a “D”, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero).

Cuando el campo 23 sea igual a “S”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

25. SUBYACENTE A RECIBIR

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.

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

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 25 (“Subyacente a Recibir”) 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 (sea igual a “TRM” o “TRE”), este campo debe ser distinto de “NA”. Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, el texto de la columna “clase_subyacente” del Anexo AF, que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntico al texto de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo 25, “Subyacente a recibir”. 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”, entonces este texto debe ser igual al texto que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo 25 es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 25, “Subyacente a Recibir”, 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 debe ser igual a “NA” (No aplica).

27. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio 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 25, “Subyacente a recibir”, sea distinto de “Divisas” o “Tasas de interés”) el valor numérico que se registre deber ser mayor o igual que diez.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio o una tasa de interés (es decir, cuando el texto de la columna “Clase del Subyacente” (clase_suby) del Anexo

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

F, que corresponda al subyacente reportado en el campo 25, “Subyacente a recibir”, sea igual a “Divisas” o “Tasas de interés”) este campo debe ser igual a “0” (cero).

Por ejemplo, si el valor del campo 25, “Subyacente a recibir”, es igual a “826 (Libra Esterlina)”, que de acuerdo a la columna “clase_suby” del Anexo F es igual a “Divisas”, entonces el valor de este campo debe ser igual a “0” (cero).

28. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe contener alguna de las claves siguientes: “N”, “M”, “F” o “I”, según sea el caso.

29. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR

En caso que el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, sea igual a “N”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que cero.

Si el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, es igual a “M”, “I” o “F”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

30. MONEDA DEL PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío cuando el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, sea igual a “N” o “F”, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero).

Cuando el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, sea igual a “M” o “I”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

31. MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, sea igual a “M” o “I”, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Modalidad de la Tasa (o Precio) de Referencia” a que se refiere el Anexo V, y ser distinta de “NA”.

Cuando el campo 28, “Forma de Calcular los Flujos a Recibir”, sea igual a “N” o “F”, este campo debe ser igual a “NA”.

32. SUBYACENTE A ENTREGAR

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.

En caso que el campo 25 (“Subyacente a Recibir”) sea igual a una tasa de interés (ya sea “TIF”, “TIM” o “TIX”), este campo debe ser distinto de una tasa de interés (es decir, distinto de “TIF”, “TIM” o “TIX”).

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

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 32 (“Subyacente a Entregar”) corresponda a un tipo de cambio (es decir, sea igual a “TIC”), un índice accionario

Uso Público

Información de acceso público.

(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 (igual a “TRM” o “TRE”), este campo debe ser distinto de “NA”. Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, el texto de la columna “clase_subyacente” del Anexo AF, que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntico al texto de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo 32, “Subyacente a entregar”. 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”, entonces este texto debe ser igual al texto que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo 32 es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 32, “Subyacente a Entregar”, es distinta de un tipo de cambio (no es igual a “TIC”), un índice accionario (no sea igual a “IAM” o “IAX”), un título de deuda (no sea 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).

En caso que el campo 26, “Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a Recibir”, sea distinto de “NA”, la clave de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 26.

34. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto a una divisa, un tipo de cambio 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 32, “Subyacente a entregar” sea distinto de “Divisas” o “Tasas de interés”) el valor numérico que se registre debe ser mayor o igual que diez.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa, un tipo de cambio 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 32, “Subyacente a entregar” sea igual a “Divisas” o “Tasas de interés”) este campo debe ser igual a “0” (cero).

Por ejemplo, si el valor del campo 32, “Subyacente a entregar” es igual a “826 (Libra Esterlina)”, que de acuerdo a la columna “clase_suby” del Anexo F es igual a “Divisas”, entonces el valor de este campo debe ser igual a “0” (cero).

35. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, debe contener alguna de las claves siguientes: “N”, “M”, “F” o “I”, según sea el caso.

36. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “N” o “F”, el valor numérico de este campo debe ser mayor que cero.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Si el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar” es igual a “M” o “I”, este campo deberá ser igual a “0” (cero).

37. MONEDA DEL PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “N” o “F”, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo E, y ser distinta de “0” (cero).

Cuando el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “M” o “I”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

38. MODALIDAD DEL PRECIO DEL SUBYACENTE, PARA DETERMINAR EL IMPORTE DE LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “M” o “I”, la clave que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Modalidad de la Tasa (o Precio) de Referencia” a que se refiere el Anexo V, y ser distinta de “NA”.

Cuando el campo 35, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “N” o “F”, este campo debe ser igual a “NA”.

39. ACUERDO RELATIVO AL PAGO DE UNA CUOTA COMPENSATORIA (“UP FRONT FEE”)

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Acuerdo de pago de Cuota Compensatoria”, a que se refiere el Anexo X.

En este campo no deberá reportarse la clave “A”.

40. VENCIMIENTO Y LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “P” o “T”.

41. TERMINACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá ser “M”, “C” o “N”.

42. 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 “swaps4”.

43. 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 42 sea distinta de “90”, se debe registrar una clave alfanumérica distinta de “NA”.

En caso que el campo 42 sea igual a “90”, este campo debe ser igual a “NA” (No aplica).

44. NÚMERO CONSECUTIVO PARA IDENTIFICAR A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN MISMO “PAQUETE” O “ESTRATEGIA”

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, cuando el campo 42 sea distinto de “90”, el valor numérico de este campo debe iniciar en uno (1) y continuar de forma secuencial

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

(1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros. 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 42).

En caso que el campo 44 sea igual a “90” (y el campo 43 igual a “NA”), este campo debe ser igual a “0” (cero).

45. 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.

46. 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.

Si el campo 47 es igual a “90” o el campo “mercado” en el Anexo L es igual a “TR”, el valor reportado en este campo deberá ser igual a “077000”.

47. 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 y ser diferente de “1”.

Adicionalmente, si el campo 46 es igual a “077000”, entonces este campo debe ser igual a “90”, si la clave reportada es diferente de “90”, ésta en el campo “mercado” del Anexo L deberá ser igual a “TR”.

Si el campo 46 es distinto de “077000”, entonces este campo debe ser distinto de “90”.

48. AGENTE DE CÁLCULO Y LIQUIDACIÓN

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

49. CLAVE DE CONFIRMACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío.

50. 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 4).

51. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN DERIVADA SUBYACENTE

En caso que el campo 42 sea igual a “6”, este campo no podrá reportarse vacío.

Si el campo 42 es igual a “28”, “44”, “46”, “49” o “90”, este campo debe reportarse vacío.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo B cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1 (“Clave de la institución”).

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

53. 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 IV (Swaps sobre subyacentes distintos a tasas de interés)

A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO. Los registros enviados por cada institución en la Sección IV, para una determinada fecha de concertación, que en el campo 11 (“Revisión de los Parámetros de la Operación”) sean igual a “SINRP”, NO deberán reportarse en esta sección. Por tanto, los registros que en la Sección IV tengan el campo 11 distinto de “SINRP”, 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 Institución”) de la Sección IV, 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 50).

2. CLAVE DE LA CONTRAPARTE.

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

La contraparte reportada deberá ser diferente a:

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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

Sin embargo, para la información anterior al primero de junio de 2018 en este campo deberán indicar la clave Banxico a seis caracteres o clave CASFIM.

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 IV.

4. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

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 IV.

5. NÚMERO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, y su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) para los siguientes registros. El valor del último registro debe ser igual al valor del campo 19 (“Número total de flujos a recibir del Swap”) de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave”.

Adicionalmente, si el campo 14, “Número del Flujo a Entregar” es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

6. IMPORTE BASE PARA EL CÁLCULO DE LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, entonces su valor numérico debe ser mayor o igual que uno. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11, “Revisión de los Parámetros de la Operación”, del registro de la Sección IV con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “00ENT”, “00REC” o “00RYE”.

Si la clave reportada en el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la Sección IV de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a “IB000”, “IBREC” o “IBRYE”, este campo deberá ser igual al campo 14, “Importe Base del Contrato que sirve de Referencia para

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Calcular los Flujos a Recibir”, de dicho registro primario de la Sección IV, cuando el campo 5, “Número de Flujos a Recibir” de esta sección se igual a “1”

Asimismo, si el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la Sección IV de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a la clave “IBENT”, este campo deberá reportarse vacío.

7. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su primer registro (que tenga el campo 5 “Número de flujo a recibir” igual a “1”), debe ser igual al campo 5, “Fecha de inicio del primer flujo a recibir”, de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 5 “Número del Flujo a Recibir” de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

8. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar el formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, este campo en su último registro, debe ser igual al campo 6, “Fecha de vencimiento del último flujo a recibir del Swap”, de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 5, “Número del Flujo a Recibir”, de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

9. SUBYACENTE A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, la clave del subyacente que se anote debe estar comprendida en el “Catálogo de Tipos de Subyacentes y Tasas de Referencia”, a que se refiere el Anexo F. Adicionalmente, este campo debe reportarse vacío, cuando el campo 11, “Revisión de los Parámetros de la Operación”, del registro de la Sección IV con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBENT” o “00ENT”.

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

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 9, “Subyacente a Recibir”, 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”), este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”. Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Asimismo, el texto de la columna “clase_subyacente” del Anexo AF, que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntico al texto de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo “9-Subyacente a recibir”. 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”, entonces este texto debe ser igual al texto que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo 9 es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 9, “Subyacente a Recibir”, 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, “Subyacente a Recibir”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

11. NÚMERO DE UNIDADES DE SUBYACENTE A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío y tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa (el campo 9, “Subyacente a Recibir”, no es igual a las claves de la “32” a la “986”), un tipo de cambio (el campo 9, “Subyacente a Recibir”, no es igual a “TIC”) o una tasa de interés (el campo 9 “Subyacente a Recibir” no es igual a “TIM” o “TIX”), entonces el valor numérico que se registre debe ser mayor o igual que diez.

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa (el campo 9 “Subyacente a Recibir” es igual a las claves de la “32” a la “986”), un tipo de cambio (el campo 9, “Subyacente a Recibir”, es igual a “TIC”) o una tasa de interés variable (el campo 9, “Subyacente a Recibir” es igual a “TIM” o “TIX”), este campo debe ser vacío. Si el campo 9, “Subyacente a Recibir”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

12. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes: “N”, “M”, “F” o “I”. Si el campo 9, “Subyacente a Recibir”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

13. PRECIO POR UNIDADES DE SUBYACENTE A RECIBIR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 12, “Forma de calcular los flujos a recibir”, sea igual a “N” o “F”, este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico deberá ser mayor que “0” (cero).

Cuando el campo 12, “Forma de calcular los flujos a recibir”, sea igual a “M”, o “I”, este campo debe ser vacío. Si el campo 9, “Subyacente a Recibir”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

14. NÚMERO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, su valor numérico debe iniciar en uno y continuar de forma secuencial (1, 2, 3, 4, etc.) en los siguientes registros. El valor del último registro debe ser igual al valor del campo 20, “Número total de flujos a entregar del Swap”, de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Uso Público

Información de acceso público.

Adicionalmente, si el campo 5, “Número del Flujo a Recibir”, es vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

15. IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, entonces su valor numérico debe ser mayor o igual que uno. Adicionalmente, debe reportarse vacío, cuando el campo 11, “Revisión de los Parámetros de la Operación”, del registro de la sección IV con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “00ENT”, “00REC” o “00RYE”.

Si la clave reportada en el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la sección IV de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a “IB000”, “IBENT” o “IBRYE”, este campo deberá ser igual al campo 16, “Importe Base del Contrato que sirve de Referencia para Calcular los Flujos a Recibir”, del registro primario de la Sección IV, cuando el campo 14, “Número de Flujos a Entregar”, de esta sección se igual a “1”.

Asimismo, si el campo 11, “Revisión de los parámetros de la operación”, del correspondiente registro primario de la Sección IV de SWAPS con los mismos campos llave que el registro de este “Complemento”, sea igual a la clave “IBREC”, este campo deberá reportarse vacío.

16. FECHA DE INICIO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su primer registro (que tenga el campo 14 “Número de flujo a entregar” igual a “1”), debe ser igual al campo 5, “Fecha de inicio del primer flujo a recibir”, de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 14 “Número del Flujo a Entregar” de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

17. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de ser no vacío, la fecha que se anote debe estar en formato AAAA/MM/DD y, en su caso, podrá ser un día inhábil bancario. Adicionalmente, la fecha de este campo en su último registro, debe ser igual al campo 8, “Fecha de vencimiento del último flujo a entregar”, de la Sección IV, para la operación que tenga los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento”.

Adicionalmente, si el campo 14, “Número del Flujo a Entregar”, de esta sección es no vacío, entonces este campo NO debe ser vacío, y debe cumplir con lo señalado en el párrafo anterior.

18. SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso de reportarse no vacío, la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo Tipos de Subyacentes y Tasas de

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Referencia”, a que se refiere el Anexo F. Adicionalmente, este campo debe reportarse vacío, cuando el campo 11, “Revisión de los Parámetros de la Operación”, del registro de la Sección IV con los mismos campos “llave” que el registro de este “Complemento” sea igual a “IB000”, “IBREC” o “OOREC”.

En caso que el campo 9, “Subyacente a Recibir”, sea igual a una tasa de interés (ya sea “TIF”, “TIM” o “TIX”), este campo debe ser distinto de una tasa de interés (es decir, distinto de “TIF”, “TIM” o “TIX”).

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

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que la clave del campo 18 (“Subyacente a Entregar”) 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”), este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”. Adicionalmente, su valor deberá estar comprendido en el “Catálogo de Claves de Título de Deuda, Acción, Índice Accionario, Tasa de Interés y Tipo de Cambio” a que se refiere el Anexo AF.

Asimismo, el texto de la columna “clase_subyacente” del Anexo AF, que corresponda al valor de este campo, debe ser idéntico al texto de la columna “clase_suby” del Anexo F, que corresponda a la clave registrada en el campo 18, “Subyacente a entregar”. 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”, entonces este texto debe ser igual al texto que corresponda a la columna “clase_suby” del Anexo F (igual a “Divisas” cuando el campo 18 es igual a “TIC”).

Si la clave del campo 18, “Subyacente a Entregar”, 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 vacío. Si el campo 18, “Subyacente a Entregar”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

En caso que el campo 10, “Clave del Valor (Deuda o Acción), Índice Accionario, Tasa de Interés o Tipo de Cambio, a Recibir” sea distinto de “NA” o vacío, la clave de este campo debe ser distinta de la clave de dicho campo 10.

20. NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío y tratándose de operaciones cuyo subyacente sea distinto de una divisa (el campo 18, “Subyacente a entregar”, no es igual a las claves de la “32” a la “986”), un tipo de cambio (el campo 18, “Subyacente a entregar”, no es igual a “TIC”) o una tasa de interés variable (el campo 18, “Subyacente a entregar” no es igual a “TIM” o “TIX”), entonces el valor numérico que se registre debe ser mayor o igual que diez.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

En el caso de operaciones cuyo subyacente sea una divisa (el campo 18, “Subyacente a entregar”, es igual a las claves de la “32” a la “986”), un tipo de cambio (el campo 18, “Subyacente a entregar”, es igual a “TIC”) o una tasa de interés variable (el campo 18, “Subyacente a entregar” es igual a “TIM” o “TIX”), este campo debe ser vacío. Si el campo 18, “Subyacente a Entregar”, está vacío, este campo debe reportarse vacío.

21. FORMA DE CALCULAR LOS FLUJOS A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, este campo debe ser igual a alguna de las claves siguientes a “N”, “M”, “F” o “I”. Si el campo 18 (“Subyacente a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

22. PRECIO POR UNIDAD DE SUBYACENTE A ENTREGAR

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que el campo 21, “Forma de calcular los flujos a entregar”, sea igual a “N” o “F”, el valor numérico de este campo debe ser mayor que “0” cero.

Si el campo 21, “Forma de calcular los flujos a entregar” es igual a “M” o “I”, este campo deberá ser vacío. Si el campo 18 (“Subyacente a Entregar”) está vacío, este campo debe reportarse vacío.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo B cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

24. 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 IV), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 3) y número de identificación de la operación (campo 4).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Sección V.- Vencimientos anticipados, o cesiones de derechos, de operaciones celebradas en mercados tanto reconocidos como no reconocidos

VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO. Los registros enviados por cada institución en la Sección V (en su fecha de vencimiento o de cesión de derechos) deben haber sido enviados previamente en las Secciones I a IV en su fecha de concertación correspondiente. Por tanto, los registros que no hayan sido reportados en su fecha de concertación **NO** deben reportarse en esta sección de vencimientos anticipados o cesiones de derecho.

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. ORÍGEN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá contener “P” o “T”. En caso que el campo 5, “Sección a la que corresponde la Operación”, sea igual a “2”, “3” o “4”, la clave de este campo debe ser igual “P”.

En caso 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 Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 6) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 13).

3. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

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.

Se deberá verificar la obligatoriedad y vigencia del Código LEI registrado en este campo.

Adicionalmente, si el campo 2 es igual a “P” la clave de este campo debe ser la misma que la del campo LEI de la Institución. En caso que el campo 2 es igual a “T”, este campo debe ser distinto a la clave del campo LEI de la Institución. Cuando la persona o entidad 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.

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 las Secciones I a IV.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

5. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser igual exclusivamente a alguna de las claves siguientes: “1”, “2”, “3” o “4”. En caso que el registro de esta sección sea igual a “1”, “2”, “3” o “4”, la operación que se debe relacionar (conforme a los tres campos “llave”) debe estar en la base de datos transaccional de la Sección “I”, o “II”, o “III” o “IV”, respectivamente.

6. FECHA DE VENCIMIENTO ANTICIPADO

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de concertación (campo 4) y menor que la “Fecha de Vencimiento del Ultimo Flujo a Recibir (o Entregar, la que sea mayor)” de la operación que tenga los mismos campos “llave”, en la sección que corresponda conforme al campo 5, “Sección a la que corresponde la Operación”.

7. FECHA DE LIQUIDACIÓN ANTICIPADA

Este campo podrá reportarse vacío. En caso que sea no vacío, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la “Fecha de vencimiento anticipado” (campo 6).

8. IMPORTE POR EL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “EX”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es distinto de “EX”, este campo debe ser igual o mayor que “0” (cero). Asimismo, si el campo 13, “La Institución Pagó o Recibió el Importe por el Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “N”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

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

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 8, “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 8 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).

10. IMPORTE ENTREGADO POR VENCIMIENTO ANTICIPADO TOTAL

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 5, “Sección a la que Corresponde la Operación” es igual a “1” o “2”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “EX”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 15 es distinto de “EX”, este campo debe ser igual o mayor que “0” (cero). Asimismo, si el campo 13, “La Institución Pagó o Recibió el Importe por el Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “N”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

11. IMPORTE A RECIBIR QUE VENDE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea distinto de “VP”, este campo debe ser igual a “0” (cero). Si el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “VP”, entonces este campo debe ser mayor que cero. Asimismo, si el campo 15 es igual a “VP”,

Uso Público

Información de acceso público.

mientras que el campo 5 es igual a “1” o “2”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo 13, “Importe Base del Contrato” de la operación de la Sección I o II que corresponda al registro de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). En caso que el campo 15 sea igual a “VP”, mientras que el campo 5 sea igual a “3” o “4”, entonces el valor de este campo debe ser menor al campo 14, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Recibir”, de la operación de la Sección III o IV que corresponda al registro de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). Adicionalmente, en caso que en la base de datos de la Sección V existan dos o más registros (con campo 5 igual a “1” o “2”), 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 V, entonces se debe sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo 11, “Importe a Recibir que vence anticipadamente en forma parcial” de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo 13, “Importe Base del Contrato” de la operación de la Sección I o II que corresponda a los registros de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). En cualquiera de los casos anteriores si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente por un monto que iguale a los campos 13, “Importe Base del Contrato” para las operaciones de las Secciones I y II o 14, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Recibir” para las operaciones de la Sección III y IV, entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 15).

Asimismo, en caso de que en la base de datos de la Sección V existan dos o más registros con campo 5 igual a “3” o “4”, 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 V, entonces se debe sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo 11, “Importe a Recibir que vence anticipadamente en forma parcial”, de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo 14, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Recibir”, de la operación de la Sección III o IV que corresponda a los registros de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). En cualquiera de los casos anteriores si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente por un monto que iguale a los campos 13, “Importe Base del Contrato”, para las operaciones de las Secciones I y II o al campo 14, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Recibir” para las operaciones de la Sección III y IV, entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 15).

12. IMPORTE A ENTREGAR QUE VENCE ANTICIPADAMENTE EN FORMA PARCIAL

Este campo no podrá reportarse vacío. Cuando el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea distinto de “VP”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el campo 5, “Sección a la que corresponda la Operación” es igual a “1” o “2”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Si el campo 5, “Sección a la que corresponda la Operación” es igual a “3” o “4”, y el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “VP”, entonces este campo debe ser mayor que cero y menor al campo 16, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Entregar”, de la operación de la Sección III o IV que corresponda al registro de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). Adicionalmente, en caso que en la base de datos de la Sección V existan dos o más registros (con campo 5 igual a “3” o “4”), 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 V, entonces se debe sumar el valor de todos los importes que aparezcan en el campo 12, “Importe a Entregar que vence anticipadamente en forma parcial” de las operaciones correspondientes. La sumatoria de los importes anteriores debe ser menor que el campo 16, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Entregar” de la operación de la Sección III o IV que corresponda a los registros de esta Sección V, conforme a los tres campos “llave” (clave de la institución, fecha de concertación y número de identificación de la operación). En cualquiera de los casos anteriores si para una misma operación se decide cancelar anticipadamente por un monto que iguale al campo 14, “Importe Base para el Cálculo de los Flujos a Recibir” para las operaciones de la Sección III y IV, entonces se deberá enviar como un vencimiento anticipado total (“VT” en el campo 15).

13. LA INSTITUCIÓN PAGÓ O RECIBIÓ EL IMPORTE POR LA VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 5, “Sección a la que corresponda la Operación”, es igual a “1” o “2”, y cuando este campo sea igual a “N”, entonces el campo 8, “Importe por el Vencimiento Anticipado Total o Cesión de Derechos” y el campo 10, “Importe Entregado por Vencimiento Anticipado Total” deben ser igual “0” (cero).

Asimismo, si el campo 5, “Sección a la que corresponda la Operación” es igual a “3” o “4”, y cuando este campo sea igual a “N”, entonces tanto el campo 8, “Importe por el Vencimiento Anticipado Total o Cesión de Derechos” como el campo 10, “Importe Entregado por Vencimiento Anticipado Total” ambos deberán ser igual a “0” (cero) o ambos mayores a “0” (cero).

Adicionalmente, si el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “EX”, entonces este campo debe ser igual a “N”. Si el campo 15, “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”.

14. MOTIVO DEL VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Este campo no podrá reportarse vacío. Asimismo, la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Motivo de la Vencimiento anticipado”, a que se refiere el Anexo R. Adicionalmente, si el campo “15-Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “CD”, entonces este campo debe ser igual a “5”.

Si el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “CP” u “OP”, entonces este campo deberá de ser igual a “4”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

15. INDICADOR DE VENCIMIENTO ANTICIPADO O CESIÓN DE DERECHOS

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “VT”, “VP”, “CD”, “CP”, “OP” o “EX”.

Adicionalmente, si el campo 14, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “5”, este campo debe ser igual a “CD”.

Si el campo 14, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” es igual a “8” o “9”, este campo debe ser igual a “EX”.

Asimismo, si el campo 14, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, es igual a “1”, “2”, “3” o “4”, este campo debe ser igual a “VT” o “VP”.

Finalmente, cuando el campo “14-Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “7”, este campo debe ser igual a “VT”.

16. 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 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 a IV.

17. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA NUEVA OPERACIÓN

Este campo podrá reportarse vacío. Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “VP” o “EX”. También debe ser vacío cuando el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea igual a “VT” y el campo 14, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea distinto de “7”.

Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 15, “Indicador de Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos”, sea igual a “VT” y el campo 14, “Motivo del Vencimiento Anticipado o Cesión de Derechos” sea igual a “7”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo B. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo B cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1 (“Clave de la institución”).

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

19. 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, III o IV conforme al campo 5, sección a la que corresponde la operación), de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 4) y número

Uso Público

Información de acceso público.

de identificación de la operación (campo 16). Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 5) es igual a 1, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

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

20. IDENTIFICADOR ÚNICO DE TRANSACCIÓN NUEVO

Este campo debe reportarse vacío cuando el campo 15 sea igual a “EX” o “VP”. Asimismo, debe ser vacío cuando el campo 15 sea igual a “VT” y el campo 14 sea distinto “7”. Adicionalmente, este campo no debe ser vacío cuando el campo 15 sea igual a “VT” y el campo 14 sea igual a “7”. En caso de que el campo 15 sea igual a “CD”, “OP” o “CP”, este campo puede ser vacío.

Adicionalmente, si el campo sección a la que corresponde la operación (campo 5) es igual a 1, entonces, este campo deberá reportarse vacío.

Por otro lado, el identificador que se registre en este campo deberá encontrarse en la Sección II, III o IV conforme al campo 5, sección a la que corresponde la operación, de acuerdo a los campos: institución, fecha de vencimiento anticipado (campo 6), número de identificación de la nueva operación (campo 17).

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

Sección VI.- Intercambios de importe base, o pago o recepción de cuota compensatoria, para las operaciones celebradas en mercados no reconocidos

- A. VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO.** Los registros enviados por cada institución en la Sección III o IV, para una determinada fecha de concertación, que en el campo 13 (“Modalidad del Intercambio de Importe Base”) sean igual a “S”, y/o enviados en las Secciones II, III o IV que en el campo 38, 41 o 39 (“Acuerdo relativo al pago de una Cuota Compensatoria o Up front fee”), respectivamente, sean igual a “N”; NO deberán reportarse en esta sección. Por tanto, los registros que en la Sección III o IV tengan el campo 13 distinto de “S”, y/o que en la Sección II, III o IV tengan el campo 38 (41 o 39, respectivamente para dichas secciones) distinto de “N”, deben reportarse en esta Sección VI.

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, III o IV, según corresponda, para la operación que tenga los mismos campos “llave”; es decir, la

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

misma “Clave de Institución” (campo 1), “Fecha de concertación” (campo 4) y “Número de Identificación de la Operación” (campo 49, 52 o 50, según se trate de la Sección II, III o IV, respectivamente).

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 VI con los correspondientes de la sección II, III o IV.

3. INDICADOR DE INTERCAMBIO DE IMPORTE BASE O CUOTA COMPENSATORIA

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “I” o “C”.

4. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “2”, “3” o “4”. En caso que el registro de esta sección sea igual a “2”, “3” o “4”, 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” o “IV”, respectivamente.

5. 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 esta Sección VI, con los correspondientes de las Secciones II, III o IV.

6. FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A RECIBIR

Este campo no puede ser vacío. Adicionalmente, se mandará un diagnóstico no grave (alerta) en caso de que la operación no cumpla con las condiciones siguientes:

Si el campo 3, “Indicador de intercambio de importes base o cuota compensatoria”, tiene el valor “I” y el campo 4, “Sección a la que corresponde la Operación”, contiene los valores “3” o “4”, estará sujeto a lo siguiente:

- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario correspondiente contiene las claves “A”, “P” o “Q”, y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección es igual a “1”, entonces la fecha reportada en el campo 6, “Fecha de liquidación del importe base (o cuota compensatoria) a recibir” deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de inicio del primer flujo a entregar” del registro primario. Adicionalmente, cuando el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección sea igual al valor máximo reportado, este campo deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de vencimiento del último flujo a recibir” del registro primario correspondiente.
- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario contiene la clave “I” y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección es igual

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

a “1”, entonces la fecha reportada en el campo 6, “Fecha de liquidación del importe base (o cuota compensatoria) a recibir”, deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de inicio del primer flujo a entregar” del registro primario correspondiente.

- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario contiene las claves “F” y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección sea igual a “1”, entonces este campo deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de vencimiento del último flujo a recibir” del registro primario correspondiente.

Si en el campo 3, “Indicador de intercambio e importe base o cuota compensatoria,” contiene el valor “C”, la fecha de este campo deberá ser mayor o igual que la “Fecha de Inicio del Primer Flujo a Recibir” de la operación que tenga los mismos campos “llave”, en la sección que corresponda conforme al campo 4, “Sección a la que corresponde la Operación”.

7. IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE RECIBE, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN

Este campo no puede ser vacío. En caso que el campo 6, “Fecha de Liquidación del Importe Base o Cuota Compensatoria a Recibir” sea no vacío, el valor numérico de este campo debe ser mayor que “0” (cero). Si el campo 6, “Fecha de Liquidación del Importe Base o Cuota Compensatoria a Recibir” es vacío, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

8. MONEDA DEL IMPORTE QUE SE RECIBE

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 7, “Importe Base o Cuota Compensatoria que se recibe, en la fecha de liquidación” sea igual a “0” (cero), entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el campo 7, “Importe Base o Cuota Compensatoria que se recibe, en la fecha de liquidación” 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).

9. FECHA DE LIQUIDACIÓN DEL IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) A ENTREGAR

Este campo no puede ser vacío. Adicionalmente, se mandará un diagnóstico no grave (alerta) en caso de que la operación no cumpla con las condiciones siguientes:

Si el campo 3, “Indicador de intercambio de importes base o cuota compensatoria”, tiene el valor “1” y el campo 4, “Sección a la que corresponde la Operación” contiene los valores “3” o “4”, estará sujeto a lo siguiente:

- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario correspondiente contiene las claves “A”, “P” o “Q”, y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección es igual a “1”, entonces la fecha reportada en el campo 9, “Fecha de liquidación del importe base (o cuota compensatoria) a

Uso Público

Información de acceso público.

entregar” deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de inicio del primer flujo a recibir” del registro primario. Adicionalmente, cuando el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección sea igual al valor máximo reportado, este campo deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de vencimiento del último flujo a entregar” del registro primario correspondiente.

- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario contiene la clave “I” y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)” de esta sección es igual a “1”, entonces la fecha reportada en el campo 9, “Fecha de liquidación del importe base (o cuota compensatoria) a entregar”, deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de inicio del primer flujo a recibir” del registro primario correspondiente.
- Si el campo 13, “Modalidad del intercambio de importes base”, del registro primario contiene las claves “F” y el campo 12, “Número secuencial para identificar intercambio de importes base (o cuota compensatoria)”, de esta sección sea igual a “1”, entonces este campo deberá ser mayor o igual a la fecha del campo “Fecha de vencimiento del último flujo a entregar” del registro primario.

Si en el campo 3, “Indicador de intercambio e importe base o cuota compensatoria”, contiene el valor “C” la fecha de este campo deberá ser mayor o igual que la “Fecha de Inicio del Primer Flujo a Entregar” de la operación que tenga los mismos campos “llave”, en la sección que corresponda conforme al campo 4, “Sección a la que corresponde la Operación”.

10. IMPORTE BASE (O CUOTA COMPENSATORIA) QUE SE ENTREGA, EN LA FECHA DE LIQUIDACIÓN

Este campo no puede ser vacío. En caso que el campo 9, “Fecha de Liquidación del Importe Base o Cuota Compensatoria a Entregar”, sea no vacío, el valor numérico de este campo debe ser mayor que “0” (cero).

Si el campo 9, “Fecha de Liquidación del Importe Base o Cuota Compensatoria a Entregar”, es vacío, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

11. MONEDA DEL IMPORTE QUE SE ENTREGA

Este campo no podrá reportarse vacío. En caso que el campo 10, “Importe Base o Cuota Compensatoria que se entrega, en la fecha de liquidación”, sea vacío, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

Si el campo 10, “Importe Base o Cuota Compensatoria que se entrega, en la fecha de liquidación”, 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).

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

12. NÚMERO SECUENCIAL DEL REGISTRO PARA IDENTIFICAR EL INTERCAMBIO DE IMPORTES BASE (O CUOTA COMPENSATORIA)

Este campo no podrá reportarse vacío, y su valor numérico 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 que tengan la misma “Fecha de concertación” (campo 2) y “Número de identificación de la operación” (campo 5).

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

Por otro lado, el identificador que se registre en este campo deberá encontrarse en la Sección II, III o IV conforme al campo 5, sección a la que corresponde la operación, de acuerdo a los campos: institución, fecha de concertación (campo 2), número de identificación de la operación (campo 5).

Sección VII.- Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, celebrada en mercados reconocidos

Nota: Los registros que la institución reporte en esta Sección VII deben corresponder (conforme a sus campos “llave”) uno a uno con los registros enviados a convalidar por personal de la Oficina de Información de Derivados.

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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1, “Clave de la Institución”, de los registros 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” (campo 7).

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 VII, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

3. 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”.

4. CLAVE DE LA PERSONA CLIENTA

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 4, “Clave de la Persona Clienta”, de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

5. FECHA DE CORTE

Este campo no podrá reportarse vacío, y debe ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha a convalidar.

6. 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 VII, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

7. PIZARRA DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “1”, “2” o “3”. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 7, “Posición en la Operación”, de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

8. CLAVE DE PIZARRA

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 8, “Clave de Pizarra”, de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

9. SOCIO LIQUIDADOR

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 14, “Socio Liquidador”, de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

10. NÚMERO DE CONTRATOS VIGENTES EN LA OPERACIÓN

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, este valor debe ser igual al del campo 10, “Número de contratos”, de los registros enviados a convalidar que tengan los mismos campos “llave”.

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.

12. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

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

13. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

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

14. DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 5, “Posición por Pizarra”, es igual a “1” o “3”, entonces este campo puede ser mayor que “0” (cero).

En caso que el campo 5, “Posición por Pizarra”, sea igual a “2”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

15. DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío. Si el campo 5, “Posición por Pizarra”, es igual a “1” o “3”, entonces este campo puede ser mayor que cero.

En caso que el campo 5, “Posición por Pizarra” sea igual a “2”, este campo debe ser igual a “0” (cero).

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

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

Si la clave o folio es distinta a “SG”, ésta deberá estar incluida (conforme los campos “llave”: institución y fecha de corte) en el campo 6 en alguno de los registros de la Sección I del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas (Garantías)”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Sección VIII, Información de la convalidación de operaciones vigentes a la fecha de corte, 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. Adicionalmente, esta clave debe ser igual a la del campo 1, “Clave de la Institución”, de los registros enviados a convalidar que tengan 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 49).

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 VIII, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

3. SECCIÓN A LA QUE CORRESPONDE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y aceptará únicamente las claves “2”, “3” o “4”. En caso que el registro de esta sección sea igual a “2”, “3” o “4”, la operación que se debe relacionar (conforme a los campos “llave”) debe estar en la base de datos enviada a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

4. FECHA DE CORTE

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de concertación de la operación (campo 2), y debe ser la misma para todos los registros que correspondan a la fecha de corte a convalidar.

5. NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN DE LA OPERACIÓN

Este campo no podrá reportarse vacío, y un mismo número de identificación no podrá asignarse a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2). Adicionalmente, este campo es uno de los campos “llave” para relacionar los registros de esta Sección VIII, con los correspondientes enviados a convalidar para la fecha de corte de que se trate.

6. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A RECIBIR

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de corte (campo 4). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

Si la fecha reportada en este campo coincide con la fecha del registro enviado a convalidar (con los mismos campos llave y de acuerdo con la sección indicada en el campo 3) reportada en el campo 6 del registro primario. Se considerará como una fecha válida únicamente si la diferencia entre este campo y la fecha del campo 4 de esta sección es menor o igual a lo indicado en el campo 18 del correspondiente registro primario, si la operación es de la Sección II, o a lo indicado en el campo 21, si es de las Secciones III o IV.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

7. FECHA DE VENCIMIENTO DEL FLUJO VIGENTE A ENTREGAR

Este campo no podrá reportarse vacío. Adicionalmente, la fecha registrada debe ser mayor que la fecha de corte (campo 4). Esta fecha puede ser un día inhábil bancario.

Si la fecha reportada en este campo coincide con la fecha del registro enviado a convalidar (con los mismos campos llave y de acuerdo con la sección indicada en el campo 3) reportada en el campo 8 del registro primario. Se considerará como una fecha válida únicamente si la diferencia entre este campo y la fecha del campo 4 de esta sección es menor o igual a lo indicado en el campo 19 del correspondiente registro primario si la operación es de la Sección II, o a lo indicado en el campo 22 si es de las Secciones III o IV.

8. OBJETIVO DE LA OPERACIÓN

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

9. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

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

10. VALUACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

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

Adicionalmente, si el campo 3, “Sección a la que corresponde la Operación” es igual a “2”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

11. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A ENTREGAR

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

12. VALUACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN, DENOMINADA EN LA MONEDA DEL IMPORTE BASE QUE SIRVE DE REFERENCIA PARA LOS FLUJOS A RECIBIR

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

Adicionalmente, si el campo 3, “Sección a la que corresponde la Operación” es igual a “2”, entonces este campo debe ser igual a “0” (cero).

13. DURACIÓN DE LA PARTE ACTIVA DE LA OPERACIÓN

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

14. DURACIÓN DE LA PARTE PASIVA DE LA OPERACIÓN

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

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

Este campo no podrá reportarse vacío y debe ser distinto de “NA”.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

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 en alguno de los registros de la Sección II del formulario denominado “Contratos que Garantizan Operaciones Derivadas (Garantías)”.

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

Este campo no podrá reportarse vacío y deberá estar comprendido en la columna “LEI” a que se refiere el Anexo “B”. Adicionalmente, el valor de este campo deberá ser el mismo que al correspondiente valor de “LEI” en el Anexo “B” cuyo valor de “CveBMXC” sea el mismo que el campo 1. (“Clave de la institución”).

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

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. Este identificador debe ser el mismo con el que se envió inicialmente dicha operación en la Sección II, III o IV del formulario SWAPS conforme al campo 5, sección a la que corresponde la operación, 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.

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)

Uso Público

Información de acceso público.

Formulario relativo a las operaciones de intercambio de flujos y rendimientos para las instituciones de crédito, casas de bolsa y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas (SWAPS)