**FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS (OFF), PARA LAS INSTITUCIONES DE CRÉDITO Y CASAS DE BOLSA. (Última actualización Marzo 2008)**

**AYUDAS GENÉRICAS**

**I.                   FUNDAMENTO LEGAL DEL REQUERIMIENTO DE INFORMACIÓN.**

**Ley del Banco de México, artículo 36.**

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

**Circular 2019/95 numeral M.73.52.**

Informes a la Dirección de Información del Sistema Financiero.

“Las instituciones deberán proporcionar a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México la información periódica que, en el ámbito de su competencia, dicha Dirección les requiera. La referida información deberá remitirse en la forma y términos que les dé a conocer la mencionada Dirección.

**Circular 115/2002 numeral CB.8.**

Información al Banco de México.

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

**Circular 1/2006 numeral BD.53.52.**

Informes a la Dirección de Información del Sistema Financiero.

“Las Instituciones deberán proporcionar a la Dirección de Información del Sistema Financiero del Banco de México la información periódica que, en el ámbito de su competencia, dicha Dirección les requiera. La referida información deberá remitirse en la forma y términos que les dé a conocer la mencionada Dirección.”

**II.                AUTORIZACIÓN DE PUBLICACIÓN.**

**Circular 1/2006 numeral BD.72.6.**

“En los contratos marco los Intermediarios deberán obtener de sus clientes, autorización para que el Banco de México, de considerarlo conveniente y con base en la información que reciba de los primeros, proporcione a los Intermediarios las cifras relativas al importe total de responsabilidades adquiridas por cada cliente y el número de intermediarios entre los que el citado importe está distribuido, guardando secreto respecto del nombre de los Intermediarios respectivos. La obtención de la referida autorización es responsabilidad de esas Instituciones, por lo que para efectos del Banco de México se entenderá que la Institución dio cumplimiento previsto en este párrafo por el solo hecho de proporcionar a la Dirección de Información del Sistema Financiero, la mencionada información.”

**III.             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 futuros y forwards, medición de la exposición al riesgo de dichas operaciones por parte de la Entidad, seguimiento de la regulación aplicable, análisis, etc.”

**IV.              DEFINICIONES.**

Para efectos de este formulario se entenderá como:

–      Operaciones, a los futuros y forwards.

–      Operaciones en “mercados reconocidos”, a los futuros celebrados en los mercados reconocidos por Banco de México para diversos efectos en la Circular 4/2006.

–      Operaciones en “mercados no reconocidos”, a los futuros celebrados en mercados distintos a los antes referidos, así como a los forwards.

–      Operaciones “Engrapadas” en “mercados no reconocidos” (OTC), a la contratación simultánea de operaciones al amparo de una sola transacción. Estas operaciones deberán cumplir, cuando menos, con lo siguiente: i) misma fecha de concertación, ii) mismo tipo de operación, de compra o de venta, iii) misma contraparte, iv) mismo subyacente, v) misma moneda de liquidación, vi) misma moneda del precio de entrega y, vii) distintas fechas de vencimiento. Cabe señalar que este tipo de operaciones se contratan, generalmente, con un mismo importe nominal y con una misma tasa o precio. Asimismo, el subyacente objeto de la operación no necesariamente debe corresponder a una tasa.

–      Operaciones “Engrapadas” en “mercados reconocidos”, a la contratación simultánea de operaciones al amparo de una sola transacción. Estas operaciones deberán cumplir, cuando menos, con lo siguiente: i) mismo número de contratos, ii) mismo tipo de operación, de compra o de venta, iii) misma tasa o precio y, iv) por el número de series sucesivas y consecutivas que determine el mercado reconocido de que se trate. Asimismo, tratándose del Mercado Mexicano de Derivados se entenderá por Operaciones “Engrapadas” a lo señalado en el Reglamento Interior MexDer, en su Capitulo Cuarto, apartado noveno, cláusulas 10066.04. y 10066.05. Para el resto de mercados reconocidos distintos a MexDer, se entenderá por “Operaciones Engrapadas” a la contratación simultánea de futuros conocida como “strips” “packs”, “bundles” o “blocks”; conforme a lo señalado en las reglas internas de cada mercado en lo particular.

–      Operaciones “Engrapadas de Divisas” en “mercados reconocidos”, a la contratación simultánea de operaciones sobre divisas al amparo de una sola operación. Estas operaciones deberán cumplir, cuando menos, con lo siguiente: i) tipo de operación de compra y de venta, ii) dos series distintas, una diaria y una mensual y, iii) la suma de los contratos de compra deberá ser igual a la suma de los contratos de venta. Esta definición sólo aplica a las operaciones celebradas en el  Mercado Mexicano de Derivados conforme a lo señalado en el Reglamento Interior del propio MexDer, en su capitulo cuarto, apartado décimo segundo, cláusulas 10066.18. y 10066.19. Cabe señalar que esta definición no aplica al resto de mercados reconocidos distintos a MexDer.

–      Estrategia (Swap cambiario), a las operaciones de compra y venta (cambiaria - cambiaria, cambiaria - forward o forward - forward), pactadas por la Institución de manera simultánea, sobre una cantidad de una divisa, con la misma contraparte y diferentes fechas de liquidación para cada una de las partes de la operación.­ Cabe señalar, que la suma de los montos negociados en las operaciones de compra, deberá ser igual a la suma de los montos negociados en las operaciones de venta, en una misma estrategia.

Para efectos de este formulario, se deberá registrar como “estrategia” a los forwards “peso - dólar” o “peso - divisa”. Asimismo, no se deberá registrar como “estrategia” a los forwards divisa – divisa, a los “engrapados de divisas en mercados reconocidos” ni a las operaciones en “mercados reconocidos” (futuros).

Ejemplo 1: Se contrata una “estrategia” que involucra una operación cambiaria fecha valor veinticuatro horas de compra, por 50 millones de dólares de los EE.UU.A., a un tipo de cambio de 10.8 pesos por dólar y de manera simultánea, dos forwards de venta: el primero por 20 millones de dólares de los EE.UU.A. a un plazo de 30 días y a un tipo de cambio de 10.9 pesos por dólar de los EE.UU.A. y el segundo por 30 millones de dólares de los EE.UU.A. a un plazo de 6 meses y aun tipo de cambio de 11.10 pesos por dólar de los EE.UU.A. Las tres operaciones contratadas con la misma contraparte.

Ejemplo 2: Se contrata una “estrategia” que involucra tres forwards, el primer forward de compra, por 75 millones de dólares de los EE.UU.A., a un tipo de cambio de 10.9 pesos por dólar a un plazo de 1 mes y dos forwards de venta; el primero por 35 millones de dólares de los EE.UU.A. a un plazo de 180 días y a un tipo de cambio de 11.15 pesos por dólar de los EE.UU.A. y el segundo por 40 millones de dólares de los EE.UU.A. a un plazo de 270 días y a un tipo de cambio de 11.25 pesos por dólar de los EE.UU.A. Las tres operaciones contratadas con la misma contraparte.

Ejemplo 3: Se contrata una “estrategia” que involucra dos forwards, el primer forward de compra, por 25 millones de dólares de los EE.UU.A., a un tipo de cambio de 10.7 pesos por dólar a un plazo de 28 días y un forward de venta por 25 millones de dólares de los EE.UU.A. a un plazo de 97 días y a un tipo de cambio de 11.12 pesos por dólar de los EE.UU.A. Las dos operaciones contratadas con la misma contraparte.

**V.                 COBERTURA DEL FORMULARIO.**

Se deberá elaborar un reporte de las operaciones celebradas por la Institución (Institución de Crédito o Casa de Bolsa, según se trate) por cuenta propia,  incluyendo tanto las operaciones en la República Mexicana como en sus Agencias y Sucursales en el Extranjero.  También  se deberá elaborar un reporte por cada una de sus entidades financieras filiales del exterior.

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.

**VI.              CONTENIDO DEL FORMULARIO.**

El reporte deberá contener todas las operaciones de futuros y forwards, una a una, incluyendo las que deriven del ejercicio de opciones sobre futuros y forwards.  Al efecto la institución no deberá realizar proceso de consolidación alguno.

**VII.           DETERMINACIÓN DE LA FORMA EN QUE SE ACTUALIZARÁ LA BASE DE DATOS (RESIDENTE EN BANCO DE MÉXICO)**

El sistema de acopio 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:

**P** Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, “en bloque” (que deben ser todas las operaciones de una determinada fecha de concertación), se van a incorporar a la base de datos por primera vez.

**S**      Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, “en bloque”, van a sustituir en la base de datos “un bloque” transmitido con anterioridad.

**V**      Si los registros de las operaciones contenidos en el archivo, constituyen datos aislados para: incorporar a la base registros por operaciones omitidas en transmisiones anteriores, dar de baja por cualquier motivo registros existentes en la base y dar de alta registros en sustitución de otros  ya existentes en la base.

**VIII.        ACTUALIZACIÓN DE CATÁLOGO DE CONTRAPARTES EN LAS OPERACIONES.**

El “Catálogo de Contrapartes” (Anexo F), será objeto de una permanente actualización, bajo las consideraciones siguientes:

–      Las Instituciones podrán solicitar al Banco de México, la inclusión de sus “contrapartes frecuentes”, tanto intermediarios financieros como personas físicas y morales; nacionales y extranjeros.

–      El Banco de México, sin perjuicio de lo indicado en el inciso anterior, incluirá todas aquellas contrapartes que, según se observe en la información, realizan frecuentemente operaciones.

–      El Banco de México, sin perjuicio de lo señalado en los incisos anteriores, dará de baja aquellas contrapartes que, según se observe en la información, dejen de realizar frecuentemente operaciones.

–      Las operaciones cuya contraparte no esté incluida en el referido “Catálogo de Contrapartes”, deberán reportarse con clave “NI” (no identificada) en la columna 24.  En el caso que los volúmenes reportados con “NI” sean significativos, el mismo Banco de México indagará con la Institución a qué contrapartes corresponde tal volumen y, en su caso, dará de alta las contrapartes que procedan.

**IX.              FECHA Y HORARIO DE ENTREGA DE LA INFORMACIÓN.**

Este formulario deberá entregarse con periodicidad diaria.  Todas las operaciones realizadas por la Institución tanto en la República Mexicana como en sus Agencias y Sucursales en el exterior, tendrán que reportarse el mismo día en que se concertaron, antes de las 17:00 Horas, y las realizadas por las filiales financieras en el exterior tendrán que reportarse el día hábil bancario inmediato siguiente al de su concertación, antes de las 13:00 Horas.

Sin perjuicio de lo señalado, “los sistemas de acopio” aceptan transmisiones de información cualquier día y sin limitación de horario.

**ESTRUCTURA DEL FORMULARIO RELATIVO A OPERACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS (OFF)**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **CAMPO** | **CLAVE** | **CONCEPTO** | **MERCADOS RECONOCIDOS 1\_/** | **MERCADOS NO RECONOCIDOS 2\_/** | **CATÁLOGO** | **LAYOUT** |
| 1 | INST | CLAVE DE LA INSTITUCIÓN  | APLICA | APLICA | SAIF | CARACTER | 6 |
| 2 | FECHA | FECHA DE CONCERTACIÓN | APLICA | APLICA |   | FECHA | AAAA/MM/DD |
| 3 | FECVEN | FECHA DE VENCIMIENTO | NO APLICA | APLICA |   | FECHA | AAAA/MM/DD |
| 4 | FECLIQ | FECHA DE LIQUIDACIÓN | NO APLICA | APLICA |   | FECHA | AAAA/MM/DD |
| 5 | OFICINA | MATRIZ O AGENCIAS Y SUCURSALES | APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 6 | OPERACION | TIPO DE OPERACIÓN    (COMPRA O VENTA) | APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 7 | MERCADO | MERCADO | APLICA | APLICA | ANEXO     A | CARACTER | 3 |
| 8 | PIZARRA | CLAVE DE PIZARRA | APLICA | NO APLICA | ANEXO     B | CARACTER | 20 |
| 9 | OBJETIVO | OBJETIVO DE LA OPERACIÓN | APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 10 | NUMCONTRAT | NÚMERO DE CONTRATOS | APLICA | NO APLICA |   | NUMERICO | (6,0) |
| 11 | NUMSUBY | NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE | NO APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (7,0) |
| 12 | MONTOBASE | MONTO BASE DEL CONTRATO | NO APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (15,0) |
| 13 | MDAMONTO | MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADO EL MONTO BASE | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 2 |
| 14 | PRECIOENT | TASA O PRECIO UNITARIO DE ENTREGA | APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (13,6) |
| 15 | MDAPRECIO | MONEDA DEL PRECIO UNITARIO DE ENTREGA | NO APLICA | APLICA | ANEXO     C | CARACTER | 2 |
| 16 | LIQUIDA | FORMA DE LIQUIDACIÓN | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 17 | MDALIQUIDA | MONEDA DE LIQUIDACIÓN | NO APLICA | APLICA | ANEXO     C | CARACTER | 2 |
| 18 | SUBY | TIPO DE SUBYACENTE | NO APLICA | APLICA | ANEXO     D | CARACTER | 3 |
| 19 | PLAZOSUBY | PLAZO DEL SUBYACENTE | NO APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (5,0) |
| 20 | MDASUBY | MONEDA DEL SUBYACENTE | NO APLICA | APLICA | ANEXO     C | CARACTER | 2 |
| 21 | TIPOGARAN | TIPO DE ACTIVO QUE CONSTITUYE LA GARANTÍA | NO APLICA | APLICA | ANEXO     E | CARACTER | 1 |
| 22 | MONTOGARAN | IMPORTE DE LA GARANTÍA | NO APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (15,0) |
| 23 | MDAGARAN | MONEDA EN QUE ESTA EXPRESADA LA GARANTÍA | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 2 |
| 24 | CONTRAPAR | CLAVE DE LA CONTRAPARTE | NO APLICA | APLICA | ANEXO     F | CARACTER | 6 |
| 25 | NOMCONTRAP | NOMBRE DE LA CONTRAPARTE | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 30 |
| 26 | RFCSS | R.F.C.  O SOCIAL SECURITY | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 15 |
| 27 | TIPOCONT | TIPO DE LA CONTRAPARTE | NO APLICA | APLICA | ANEXO     G | CARACTER | 3 |
| 28 | NUM\_ID | NÚMERO DE IDENTIFICACION | APLICA | APLICA |   | CARACTER | 34 |
| 29 | MODIFICA | ALTAS Y BAJAS | APLICA | APLICA | ANEXO     H | CARACTER | 2 |
| 30 | ESTRATEGIA | CAMPO CON EL QUE SE IDENTIFICA SI LA OPERACIÓN FORMA PARTE O NO DE UNA "ESTRATEGIA" | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 31 | ID\_ESTRA | CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA A LA OPERACIÓN O AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA ESTRATEGIA | NO APLICA | APLICA |   | CARACTER | 34 |
| 32 | ENGRAPADO | CAMPO CON EL QUE SE IDENTIFICA A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN "ENGRAPADO" | APLICA | APLICA |   | CARACTER | 1 |
| 33 | PRECIO\_EBG | TASA O PRECIO QUE CORRESPONDE A LA OPERACIÓN ANTES DE SER "ENGRAPADA" | APLICA | APLICA |   | NUMERICO | (13,6) |

NOTAS: En los campos de tipo numérico, el primer dígito que aparece dentro de los paréntesis indica el número de caracteres totales del campo  (incluyendo enteros, PUNTO y decimales) y el segundo, indica el número de decimales. Cuando el tipo numérico indica 0 decimales, no se incluye el punto en el tamaño del campo.

1/         Se entenderá por operaciones en “mercados reconocidos”, a los futuros celebrados en los mercados reconocidos por Banco de México para diversos efectos en la Circular 2019/95

2/         Se entenderá por operaciones en “mercados no reconocidos”, a los futuros celebrados en mercados distintos a los antes referidos, así como a los forwards.

**AYUDAS ESPECÍFICAS DEL FORMULARIO RELATIVO A LAS OPERACIONES DE FUTUROS Y FORWARDS (OFF), PARA LAS INSTITUCIONES DE CRÉDITO Y CASAS DE BOLSA**

**AYUDAS DE LLENADO PARA CADA CAMPO**

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

**1.-       CLAVE DE LA INSTITUCIÓN.**

Se deberá anotar 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.

**2.-       FECHA DE CONCERTACIÓN.**

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

**3.-       FECHA DE VENCIMIENTO.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar la fecha de vencimiento del contrato, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**4.-       FECHA DE LIQUIDACIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar la fecha de liquidación, a su vencimiento, del contrato, con formato AAAA/MM/DD.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**5.-       MATRIZ O AGENCIAS Y SUCURSALES.**

Se deberá anotar:

**R**          Cuando la operación de que se trate esté documentada como realizada por la oficina matriz o por otras oficinas de la Institución en la República Mexicana.

**A** Cuando la operación de que se trate esté documentada como realizada por alguna de las Agencias o Sucursales en el Extranjero (fuera de la República Mexicana), de la Institución.

**F** Tratándose del reporte de las operaciones realizadas por alguna de las Entidades Financieras Filiales en el Extranjero (fuera de la República Mexicana), de la Institución.

**6.-       TIPO DE OPERACIÓN.**

Se deberá anotar:

**C**         Cuando se trate de una operación de compra.

**V**         Cuando se trate de una operación de venta.

**7.-       MERCADO.**

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, se deberá anotar la clave del “mercado” donde se realice la operación, conforme al “Catálogo de Mercados Reconocidos” a que se refiere el Anexo A.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, en esta columna se deberá reportar “E”.

**8.-       “CLAVE DE PIZARRA”.**

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, se deberá anotar la “clave de pizarra” relativa al contrato, conforme al “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo B.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**9.-       OBJETIVO DE LA OPERACIÓN.**

Se deberá anotar:

**C**         Cuando la Institución realice la operación con el objetivo de cobertura.

**E**          Cuando la Institución realice la operación con el objetivo de especulación.

**10.-   NÚMERO DE CONTRATOS.**

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, se deberá anotar el número de contratos negociados, de compra o venta, según sea el caso (en unidades).

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**11.-   NÚMERO DE UNIDADES DEL SUBYACENTE.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar el número de unidades del subyacente, en unidades, que ampare la correspondiente operación (multiplicando, en su caso, el número de contratos por el número de subyacentes que ampara cada contrato).

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario), así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**12.-   “MONTO BASE” DEL CONTRATO.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario), se deberá anotar el “monto base” (monetario) del contrato, en miles (redondeado sin decimales): de pesos, de UDIS o de dólares de los EE.UU.A.; al efecto las operaciones con “monto base” en divisas distintas al referido dólar deberán convertirse a tal moneda aplicando un tipo de cambio representativo de mercado.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica en unidades de contrato o de subyacente, así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**13.-   MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADO EL “MONTO BASE”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario), se deberá anotar:

**01**        Cuando dicho “monto base” a que se refiere la columna 12, se denomine en moneda nacional.

**02**        Cuando dicho “monto base” a que se refiere la columna 12, se denomine en unidades de inversión (UDIS).

**10**        Cuando dicho “monto base” a que se refiere la columna 12, se denomine en dólares de los EE.UU.A.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica en unidades de contrato o de subyacente, así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**14.-   PRECIO UNITARIO O TASA, DE ENTREGA.**

Según sea el caso, se deberá anotar (con enteros y seis decimales) el precio unitario (por contrato tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, o por unidad de subyacente, tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, este último que resulte, en su caso, de dividir el precio por contrato entre el número de subyacentes que ampara cada contrato) o tasa, de entrega pactado(a) en la operación.

En el caso de dicho precio, éste se deberá anotar en unidades (con seis decimales) de la moneda en que está expresado.

**15.-   MONEDA DEL PRECIO UNITARIO DE ENTREGA.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), se deberá anotar, en su caso, la clave de moneda en que está expresado el precio de entrega, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**16.-   FORMA DE LIQUIDACIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar:

**S**          Cuando la operación tenga que ser liquidada mediante entrega del subyacente.

**D**         Cuando la operación tenga que ser liquidada “por diferencias”.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**17.-   MONEDA DE LIQUIDACIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar la clave de la moneda con que se liquidará el subyacente o, en su caso, “la diferencia”, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**18.-   TIPO DE SUBYACENTE.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar la clave del subyacente objeto de la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo D.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**19.-   PLAZO DEL SUBYACENTE.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo subyacente tenga o esté referido a algún plazo, se deberá anotar el “plazo” o el “plazo de referencia” del subyacente contratado, expresado en días.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” en cuyo subyacente no exista “plazo” o “plazo de referencia”, así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**20.-   MONEDA DEL SUBYACENTE.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, en su caso, se deberá anotar la clave de la moneda en que se cotice o a que esté referido el subyacente, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**21.-   TIPO DE ACTIVO QUE CONSTITUYE LA GARANTÍA OTORGADA POR LA CONTRAPARTE A LA INSTITUCIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” en los que la contraparte le haya otorgado alguna garantía a la Institución, se deberá anotar la clave del tipo de activo que constituye la garantía conforme al “Catálogo de Tipos de Activo que Constituyen la Garantía” a que se refiere el Anexo E.  En el caso de operaciones con diversos tipos de activo en garantía, se deberá anotar la clave que corresponda al tipo de activo con el mayor valor.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” que se hayan concertado sin garantía para la Institución, se deberá registrar “S” (Sin Garantía).

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse vacía.

**22.-   IMPORTE DE LA GARANTÍA OTORGADA POR LA CONTRAPARTE A LA INSTITUCIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” en los que la contraparte le haya otorgado alguna garantía a la Institución, se deberá anotar el importe, a valor de mercado, total de la garantía, en miles (redondeado sin decimales): de pesos,  de UDIS o de dólares de los EE.UU.A.; al efecto los importes en divisas distintas al referido dólar deberán convertirse a tal moneda aplicando un tipo de cambio representativo de mercado.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” sin garantía para la Institución (“S” en la columna 21), así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse vacía.

**23.-   MONEDA EN QUE ESTÁ EXPRESADA LA GARANTÍA OTORGADA POR LA CONTRAPARTE A LA INSTITUCIÓN.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” en los que la contraparte le haya otorgado alguna garantía a la Institución, se deberá anotar:

**01**    Cuando la garantía a que se refiere la columna 22, se denomine en moneda nacional.

**02**    Cuando la garantía a que se refiere la columna 22, se denomine en unidades de inversión (UDIS).

**10**    Cuando la garantía a que se refiere la columna 22, se denomine en dólares de los EE.UU.A.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” sin garantía para la Institución (“S” en la columna 21), así como de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse vacía.

**24.-   CLAVE DE LA CONTRAPARTE.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, se deberá anotar la clave de la contraparte, conforme al “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo F.  En el caso que la contraparte de dichos operaciones en “mercados no reconocidos” no se identifique individualmente en el referido catálogo, se deberá anotar “NI” (Contraparte No Identificada Individualmente).

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, esta columna deberá reportarse “vacía”.

**25.-   NOMBRE DE LA CONTRAPARTE.**

Esta columna así como la 26 y 27, aplican sólo para operaciones en “mercados no reconocidos” cuya contraparte NO se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo F (“NI” en la columna 24).

Se deberá anotar el nombre completo de la contraparte de la operación, sin incluir, en su caso, la razón social (sin abreviaturas, sin guiones, sin puntos y dejando sólo un espacio entre palabra y palabra):

–      Personas Morales: El nombre completo de la empresa (sin razón social).

–      Personas Físicas: Apellido Paterno, Apellido Materno y Nombres.

**26.-   REGISTRO FEDERAL DE CONTRIBUYENTES DE LA CONTRAPARTE.**

Esta columna así como la 25 y 27, aplican sólo para operaciones en “mercados no reconocidos” cuya contraparte NO se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo F (“NI” en la columna 24).

Se deberá anotar el Registro Federal de Contribuyentes de la contraparte de la operación (o “Social Security” o clave de registro equivalente); utilizando exclusivamente mayúsculas, sin puntos, sin guiones y sin dejar espacio alguno.

**27.-   TIPO DE CONTRAPARTE.**

Esta columna así como la 25 y 26, aplican sólo para operaciones en “mercados no reconocidos” cuya contraparte NO se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo F (“NI” en columna 24).

Se deberá anotar la clave del tipo de contraparte de la operación, conforme al “Catálogo de Tipos de Contraparte” a que se refiere el Anexo G.

**28.-   NÚMERO DE IDENTIFICACIÓN.**

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

**29.-   ALTAS Y BAJAS.**

Este campo deberá reportarse vacío en aquellas operaciones que se estén informando en tiempo y forma.  Por lo tanto, deberá utilizarse sólo en operaciones que se estén reportando con posterioridad al plazo establecido o dando de alta o de baja, por cualquier motivo.  Al efecto, se deberá anotar la clave que corresponda conforme al “Catálogo de Altas y Bajas” a que se refiere el Anexo H.

**30.-   CAMPO CON EL QUE SE IDENTIFICA SI LA OPERACIÓN FORMA PARTE O NO DE UNA “ESTRATEGIA”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos”, en este campo se deberá registrar “1” (uno) si la operación forma parte de una “estrategia” o bien, “0” (cero) si la operación no forma parte de una “estrategia”. Por “estrategia” se deberá entender a lo señalado en el séptimo párrafo de la “Ayuda IV” Genérica del formulario OFF.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, este campo deberá reportarse “vacío”.

**31.-   CLAVE O FOLIO CON EL QUE SE IDENTIFICA A LA OPERACIÓN O AL CONJUNTO DE OPERACIONES QUE FORMAN PARTE DE UNA “ESTRATEGIA”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” que formen parte de una misma estrategia (“1” <uno> en el campo 30), se deberá anotar la clave o folio que sirva para identificar a la operación en lo individual, o bien, a todas y cada una de las operaciones que formen parte de la misma “estrategia”. Por “estrategia” se deberá entender a lo señalado en el séptimo párrafo de la “Ayuda IV” Genérica del formulario OFF.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” que no formen parte de una misma estrategia (“0” <cero> en el campo 30) o bien, tratándose de operaciones en “mercados reconocidos”, este campo deberá reportarse “vacío”.

**32.-   CAMPO CON EL QUE SE IDENTIFICA A LA OPERACIÓN QUE FORMA PARTE DE UN “ENGRAPADO”.**

Se deberá anotar “1” (uno) si la operación forma parte de un “engrapado” o bien, “0” (cero) si la operación no forma parte de un “engrapado”. Por “engrapado” se deberá entender a lo señalado en los  párrafos 4, 5 ó 6 de la “Ayuda IV” Genérica del formulario OFF (“Operaciones Engrapadas en Mercados No Reconocidos”, “Operaciones Engrapadas en Mercados Reconocidos” y “Operaciones Engrapadas de Divisas en Mercados Reconocidos”, indistintamente).

**33.-   TASA O PRECIO QUE CORRESPONDE A LA OPERACIÓN ANTES DE QUE FORME PARTE DE UN “ENGRAPADO”.**

Tratándose de operaciones que formen parte de un “engrapado” (“1” <uno> en el campo 32), en este campo se deberá anotar la tasa o precio de cada operación en lo individual, antes de que forme parte de un “engrapado”, para su correspondiente fecha de vencimiento. Es decir, se solicita el precio futuro ‘genuino’ de cada operación en lo individual, previo al cálculo o ponderación de la tasa o precio “engrapado”, ya que dicha tasa o precio engrapado se solicita en el campo “14. PRECIO UNITARIO O TASA, DE ENTREGA”. Por “engrapado” se deberá entender a lo señalado en los  párrafos 4, 5 ó 6 de la “Ayuda IV” Genérica del formulario OFF (“Operaciones Engrapadas en Mercados No Reconocidos”, “Operaciones Engrapadas en Mercados Reconocidos” y “Operaciones Engrapadas de Divisas en Mercados Reconocidos”, indistintamente).

Tratándose de operaciones que no formen parte de un “engrapado” (“0” <cero> en el campo 32), este campo deberá reportarse “vacío”.

**VALIDACIONES QUE SE REALIZARÁN EN EL SISTEMA DE ACOPIO DE INFORMACIÓN FINANCIERA (OFF-SAIF).**

**A.      VALIDACIONES REGISTRO POR REGISTRO**

**1.           Clave de la Institución.**

Este campo no podrá reportarse vacío.

El número que se anote deberá corresponder al asignado para estos propósitos, conforme al “Catálogo de Instituciones” incorporado al SAIF.

**2.           Fecha de Concertación.**

Este campo no podrá reportarse vacío.

**3.           Fecha de Vencimiento.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío.  La fecha registrada deberá ser mayor a la fecha de concertación  (campo 2).

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**4.           Fecha de Liquidación.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío, y la fecha registrada deberá ser igual o mayor a la fecha de vencimiento (campo 3).

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**5.           Matriz o Agencias y Sucursales.**

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

**6.           Tipo de Operación.**

Este campo no podrá reportarse vacío.

Deberá contener “C” o “V”, según sea el caso.

**7.           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 A.

**8.           “Clave de Pizarra”.**

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), se deberá anotar la “clave de pizarra” que corresponda de entre las comprendidas en el “Catálogo de Claves de Pizarra” a que se refiere el Anexo B.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**9.           Objetivo de la Operación.**

Este campo no podrá reportarse vacío.

Deberá contener “C” o “E”, según sea el caso.

**10.      Número de Contratos.**

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**11.      Número de Unidades del Subyacente.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica en unidades de contrato o de subyacente (y vacío en la columna 12), este campo no podrá reportarse vacío.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), así como de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario) (con importe en la columna 12), este campo deberá reportarse vacío.

**12.      “Monto Base” del Contrato.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario) (y vacío en la columna 11), este campo no podrá reportarse vacío.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7) así como de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica en unidades de contrato o de subyacente (con importe en la columna 11), este campo deberá reportarse vacío.

**13.      Moneda en que Está Expresado el “Monto Base”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica mediante un “monto base” (monetario) (con importe en  la columna 12), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener “01” ó “02” ó “10”, según sea el caso.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7) así como de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuyo contrato establezca que la operación se cuantifica en unidades de contrato o de subyacente (vacío en la columna 12), este campo deberá reportarse vacío.

**14.      Tasa o Precio Unitario, de Entrega.**

Este campo no podrá reportarse vacío.

**15.      Moneda del Precio Unitario de Entrega.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), se deberá anotar, en su caso, la clave de moneda en que está expresado el precio de entrega, conforme al “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), esta columna deberá reportarse “vacía”.

**16.      Forma de Liquidación.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener “S” o “D”, según sea el caso.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**17.      Moneda de Liquidación.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío, y la clave de moneda que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**18.      Tipo de Subyacente.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), este campo no podrá reportarse vacío, y la clave del subyacente que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Tipos de Subyacente” a que se refiere el Anexo D.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**19.      Plazo del Subyacente.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), cuyo subyacente tenga o esté referido a algún plazo (claves “V01”, “V02”, “V03”, “V50”, “V60”, “V62”, “V63”, “V64”, “V66”, “V67”, “V70”, “V80”, “T01”, “T02”, “T03”, “T25”, “T30”, “T31”, “T32”, “T33”, “T34”, “T35”, “T36”, “T37”, “T50”, “T60” y “T61” en la columna 18), este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar el “plazo” o el “plazo de referencia” del subyacente contratado, expresado en días.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), así como de operaciones en “mercados no reconocidos” cuyo subyacente no tenga o esté referido a algún plazo (claves distintas a “V01”, “V02”, “V03”, “V50”, “V60”, “V62”, “V63”, “V64”, “V66”, “V67”, “V70”, “V80”, “T01”, “T02”, “T03”, “T25”, “T30”, “T31”, “T32”, “T33”, “T34”, “T35”, “T36”, “T37”, “T50”, “T60” y “T61” en la columna 18), este campo deberá reportarse vacío.

**20.      Moneda del Subyacente.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7), según sea el caso, en este campo se deberá anotar la clave de moneda que corresponda de entre las comprendidas en el “Catálogo de Monedas” a que se refiere el Anexo C, o bien reportarse vacío.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**21.      Tipo de Activo que Constituye la Garantía Otorgada por la Contraparte a la Institución.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) este campo no podrá reportarse vacío, y la clave que se anote deberá estar comprendida en el “Catálogo de Tipos de Activo que Constituyen la Garantía” a que se refiere el Anexo E.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**22.      Importe de la Garantía Otorgada por la Contraparte a la Institución.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” con garantía para la Institución (con clave distinta de “S” en la columna 21), este campo no podrá reportarse vacío.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” sin garantía para la Institución (con clave “S” en la columna 21), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**23.      Moneda en que Está Expresada la Garantía Otorgada por la Contraparte a la Institución.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” con garantía para la Institución (con clave distinta de “S” en la columna 21), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener ”01” o “02” o “10”, según se trate.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” sin garantía para la Institución (con clave “S” en la columna 21), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**24.      Clave de la Contraparte.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7),esta columna no deberá reportarse vacía, y se deberá anotar la clave de contraparte que corresponda específicamente de entre las comprendidas en el “Catálogo de Contrapartes” a que se refiere el Anexo F, o bien “NI” (Contraparte No Identificada Individualmente).

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), este campo deberá reportarse vacío.

**25.      Nombre de la Contraparte.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuya contraparte no se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (“NI” en la columna 24), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener el nombre completo de la contraparte, incluida, en su caso, la razón social (sin abreviaturas, sin guiones, sin puntos y, en su caso, dejando sólo un espacio entre palabra y palabra).

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en columna 7) cuya contraparte sí se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (clave distinta de “NI” en la columna 24), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), esta columna deberá reportarse vacía.

**26.      Registro Federal de Contribuyentes de la Contraparte.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuya contraparte no se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (“NI” en la columna 24), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener el Registro Federal de Contribuyentes (o “Social Security” o clave de registro equivalente) de dicha contraparte; utilizando exclusivamente mayúsculas, sin puntos, sin guiones y sin dejar espacio alguno.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en columna 7) cuya contraparte sí se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (clave distinta de “NI” en la columna 24), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), esta columna deberá reportarse vacía.

**27.      Tipo de Contraparte.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en la columna 7) cuya contraparte no se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (“NI” en la columna 24), este campo no podrá reportarse vacío, y deberá contener la correspondiente clave de tipo de contraparte de entre las comprendidas en el “Catálogo de Tipos de Contraparte” a que se refiere el Anexo G.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en columna 7) cuya contraparte sí se identifique individualmente en el “Catálogo de Contrapartes” (clave distinta de “NI” en la columna 24), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (cualquier clave comprendida en el Anexo A, distinta de “E”, en la columna 7), esta columna deberá reportarse vacía.

**28.      Número de Identificación.**

Este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar un número para identificar a cada registro el cual podrá ser: secuencial o el folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar sus operaciones; sobre la base que un mismo número de identificación no podrá asignársele a dos o más registros que tengan la misma fecha de concertación (campo 2).

**29.      Altas y Bajas.**

Este campo deberá reportarse vacío en aquellas emisiones que se estén informando en tiempo y forma.  Por lo tanto, deberá utilizarse sólo en operaciones que: se estén informando en fecha posterior a la establecida para el efecto o se estén dando de alta o de baja, por cualquier motivo.

Los registros de alta por cualquier motivo, además de la clave “AS” o “AO” en este campo, según sea el caso, deberán contener la información de todos los correspondientes campos.

Los registros de baja por cualquier motivo, además de la clave “BS” o “BI” en este campo, según sea el caso, deberán contener (cuando menos) la información de los campos: “1. Clave de la de Institución”, “2. Fecha de Concertación”, “3. Fecha de Vencimiento” y “28 Número de Identificación”.

Cuando la institución envíe una baja y una alta, y dicha baja contenga información equivocada y por lo tanto no se pueda localizar en la “base de datos” el registro que se pretende cancelar, la misma institución deberá enviar adicionalmente dos registros: uno con clave “EB” para eliminar la baja con información equivocada, y otro con clave “NB” para efectivamente dar de baja el registro que se pretende cancelar.  Cabe señalar que en este caso el primer registro de alta se incorporará a la base sin perjuicio de lo señalado y por lo tanto ya no debe ser objeto de un nuevo envío de alta.

Cuando la institución envíe una baja y una alta, y dicha alta contenga información equivocada, para corregir la “base de datos” la institución deberá enviar adicionalmente dos registros: uno con clave “BS” para cancelar el registro equivocado (de alta) y otro con clave “AS” para dar de alta el registro correcto.  Cabe señalar que en este caso el primer registro de baja propiciará que se cancele en la base de datos la correspondiente operación y por lo tanto ya no debe ser objeto de un nuevo envío de baja.

**30.      Campo con el que se identifica si la operación forma parte o no de una “Estrategia”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en el campo “7”), este campo no podrá reportarse vacío y sólo podrá aceptar las claves “0” (cero) y “1” (uno).

Cuando en este campo se registre “0”:

i)      El campo “31” deberá reportarse vacío.

Cuando en este campo se registre “1”:

i)      El campo “13. Moneda en que está expresado el monto base” deberá aceptar sólo la clave “10” (USD).

ii)    El campo “17. Moneda de Liquidación” sólo podrá aceptar alguna de las siguientes claves:    “01” (MXP), “02” (UDI), “10” (USD), “20” (CAD), “21” (VEB), “22” (BRL), “23” (CLP), “24” (UFC), “25” (ARP), “27” (PEN), “30” (EUR), “33” (AUD), “36” (NZD), “38” (SGD), “40” (JPY), “45” (CNY), “55” (DKK), “60” (GBP), “65” (NOK), “70” (CHF), “75” (SEK) y, “91” (ZAR). Adicionalmente, cuando en este campo se registre la clave “01” (MXP), el campo 18 sólo deberá aceptar una clave distinta de “001” (MXP).

iii)   El campo “18. Tipo de Subyacente” sólo podrá aceptar alguna de las siguientes claves: “001” (MXP), “002” (UDI), “010” (USD), “020” (CAD), “021” (VEB), “022” (BRL), “023” (CLP), “024” (UFC), “025” (ARP), “027” (PEN), “030” (EUR), “033” (AUD), “036” (NZD), “038” (SGD), “040” (JPY), “045” (CNY), “055” (DKK), “060” (GBP), “065” (NOK), “070” (CHF), “075” (SEK) y, “091” (ZAR). Adicionalmente, cuando en este campo se registre la clave “001” (MXP), el campo 17 sólo deberá aceptar una clave distinta a “01” (MXP).

iv)  El campo “31” no podrá reportarse vacío.

v)   El sistema (SAIF) reunirá el universo de operaciones que formen parte de una “estrategia” para la fecha de concertación de que se trate, y realizará un cruce de información tanto de manera “interna” (forward - forward) en el formulario OFF así como frente a las operaciones cambiarias reportadas en la sección VIII del formulario ACLME (cambiaria - forward). El sistema también validará que este tipo de operaciones cumplan con los correspondientes requisitos para ser consideradas como “estrategia”.

Tratándose de operaciones en “mercados reconocidos” (clave distinta de “E” en el campo “7”), este campo deberá reportarse “vacío”.

**31.      Clave o folio con el que se identifica a la operación o al conjunto de operaciones que forman parte de una “Estrategia”.**

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en el campo “7”) y que formen parte de una estrategia (“1” <uno> en el campo “30”), este campo no podrá reportarse vacío, y se deberá anotar la clave o folio (alfanumérico) que utilice la institución para identificar a la operación que forma parte de una “estrategia”;  sobre la base de que una misma clave o folio de identificación deberá asignársele a cada uno de los registros que formen parte de la misma “estrategia”,  para la misma fecha de concertación (campo “2”) y con la misma contraparte.

Tratándose de operaciones en “mercados no reconocidos” (“E” en el campo “7”) y que no formen parte de una estrategia (“0” <cero> en el campo “30”), así como de operaciones en “mercados reconocidos” (clave distinta a “E” en el campo “7”), este campo deberá reportarse “vacío”.

**32.      Campo con el que se identifica a la operación que forma parte de un “Engrapado”.**

Este campo no deberá reportarse vacío y sólo podrá aceptar las claves “0” (cero) y “1” (uno).

**33.      Tasa o precio que corresponde a la operación antes de que forme parte de un “Engrapado”.**

Tratándose de operaciones que formen parte de un “engrapado”  (“1”< uno> en el campo “32”), este campo no podrá reportarse vacío.

Tratándose de operaciones que no formen parte de un engrapado (“0”< cero> en el campo “32”), este campo deberá reportarse “vacío”.