



INSTITUTO MEXICANO DEL SEGURO SOCIAL
SEGURIDAD Y SOLIDARIDAD SOCIAL

DIRECCIÓN DE FINANZAS

NOMBRE Y CLAVE

Procedimiento para el control operativo de las operaciones de inversión
6A10-003-004

AUTORIZACIÓN

Aprobó

Mtro. Marco Aurelio Ramírez Corzo
Titular de la Dirección de Finanzas

Revisó

Mtro. César Daniel Rojas Flores
Titular de la Unidad de Inversiones
Financieras

L.C. María Vianney Rubio Concha
Titular de la Coordinación de Control de
Operaciones

Elaboró

COORDINACIÓN DE MODERNIZACIÓN
Y COMPETITIVIDAD

L.C.P. Isai Villaseñor García
Titular de la División de Registros y Control Operativo

MOVIMIENTO VALIDADO Y REGISTRADO

ACTUALIZACIÓN 09 ENE 2024

"El personal realizará sus labores con apego al Código de Conducta y de Prevención de Conflictos de Interés de las Personas Servidoras Públicas del IMSS, utilizando lenguaje incluyente y salvaguardando los principios de igualdad, legalidad, honradez, lealtad, imparcialidad y eficiencia que rigen el servicio público, así como con pleno respeto a los derechos humanos y a la no discriminación".



ÍNDICE

		Página
1	Base normativa	3
2	Objetivo	3
3	Ámbito de aplicación	3
4	Definiciones	4
5	Políticas	6
6	Descripción de actividades	8
7	Diagrama de flujo	16
	Anexos	
	Anexo 1 Instrucciones de operación para la generación del RDO, clave 6A10-005-001	20
	Anexo 2 Instrucciones de operación para la carga de tasas y actualización de fechas, clave 6A10-005-002	27
	Anexo 3 Instrucciones para captura de ventas, clave 6A10-005-003	34



1 Base normativa

- Artículos 278 a 286 E, de la Ley del Seguro Social, publicada en el Diario Oficial de la Federación el 21 de diciembre de 1995 y sus reformas.
- Artículos 70, fracción XIV, del Reglamento Interior del Instituto Mexicano del Seguro Social publicado en el Diario Oficial de la Federación el 18 de septiembre de 2006 y sus reformas.
- Numerales 7.1.1, párrafos 2, 3 y 4; 7.1.1.2 párrafos 1, 2 y 5; y 7.1.1.2.1 párrafos 1, 2, 4, 5 y 6, del Manual de Organización de la Dirección de Finanzas, clave 6000-002-001, con fecha de registro 30 de diciembre de 2022.
- Numeral 7.4.3, párrafo tercero, de las Políticas y Directrices para la Inversión de la Reserva General Financiera y Actuarial y las Reservas Financieras y Actuariales, clave 6000-001-007, con fecha de registro 23 de junio de 2023.
- Numeral 7.4.2, párrafo tercero, de las Políticas y Directrices para la Inversión de las Reservas Operativas y la Reserva de Operación para Contingencias y Financiamiento, clave 6000-001-008, con fecha de registro 23 de junio de 2023.
- Numeral 7.4.3, párrafo tercero, de las Políticas y Directrices para la Inversión del Fondo para el Cumplimiento de Obligaciones Laborales de Carácter Legal o Contractual, clave 6000-001-009, con fecha de registro 23 de junio de 2023.
- Numeral 7.4.3, párrafo tercero, de las Políticas y Directrices para la Inversión de la Reserva correspondiente al Artículo 302 de la Ley del Seguro Social, clave 6000-001-011, con fecha de registro 23 de junio de 2023.

2 Objetivo

Establecer los procesos de control de las inversiones financieras de las reservas y Fondo Laboral del Instituto Mexicano del Seguro Social, así como de los recursos de terceros que éste administra, para una correcta valuación y posteriormente permita realizar el registro contable de las mismas que ayude en la toma de decisiones.

3 Ámbito de aplicación

El presente procedimiento es de observancia obligatoria para el personal adscrito a la Coordinación de Control de Operaciones y a la División de Registros y Control Operativo.



4 Definiciones

Para efectos del presente procedimiento se entenderá por:

4.1 acciones: Títulos que representan la parte alícuota del capital social de una persona moral.

4.2 amortización parcial: Derecho del emisor a pagar anticipadamente una parte del principal insoluto de los instrumentos emitidos.

4.3 Banxico: Banco de México. Banco central del país que provee la moneda nacional y promueve el sano desarrollo de los sistemas financiero y de pagos.

4.4 Bolsa Mexicana de Valores: Entidad financiera que opera por concesión de la Secretaría de Hacienda y Crédito Público, con apego a la Ley del Mercado de Valores. Es el foro en el que se llevan a cabo las operaciones del mercado de valores organizado en México, siendo su objeto el facilitar las transacciones con valores y procurar el desarrollo del mercado, fomentar su expansión y competitividad.

4.5 blotter.xls: Archivo electrónico de Excel que elabora la Coordinación de Inversiones con el detalle de las operaciones pactadas en el día.

4.6 carta asignación: Confirmación escrita que indica el monto, tasa, plazo, títulos, precios, emisión, serie, tipo valor y reserva a la que corresponden las operaciones pactadas, con las contrapartes autorizadas para el Instituto.

4.7 CIF: Comisión de Inversiones Financieras del Instituto Mexicano del Seguro Social, órgano especializado del H. Consejo Técnico facultado para proponer a éste las estrategias, políticas y directrices para la inversión de los recursos financieros del Instituto, así como para evaluar y supervisar su aplicación.

4.8 corte de cupón: Se refiere al momento en que el tenedor de un título financiero cobrará los intereses (rendimientos) con base en las características y periodicidad establecida para cada instrumento financiero.

4.9 DMs: Código alfanumérico con el que se identifican las operaciones financieras de inversión, capturadas por la División de Confirmaciones y Liquidaciones en el sistema PREI Inversiones Financieras, compuesto por el prefijo DM (Deal Management) y un consecutivo de 10 números.

4.10 expediente: Soporte documental de las operaciones diarias de inversión y movimientos de flujo (ingresos, egresos, traspasos, cartas confirmación, entre otros).

4.11 IMSS o Instituto: Instituto Mexicano del Seguro Social.



4.12 instrumento financiero: Cualquier derecho u obligación que surge de un contrato que da origen a un activo financiero en una entidad y a un pasivo financiero en otra.

4.13 layouts de mandatarios: Archivo que contiene la información diaria de las operaciones de inversión realizadas y liquidadas por cada Mandatario.

4.14 mandatario: Institución financiera a la cual el Instituto otorga a través de un contrato, un mandato de intermediación financiera para llevar a cabo la estrategia de inversión en el en el mercado de capitales.

4.15 mandatos de inversión: Contrato que consiste en segregar una parte del portafolio de inversión para invertir los recursos a través de un tercero experto, denominado mandatario, en inversiones, mercados, monedas, regiones o sectores que generalmente implican un conocimiento especializado y operación compleja, tales como horarios y regulaciones, entre algunos aspectos.

4.16 oferta pública: Documento informativo que establece los términos y características del instrumento financiero a emitir.

4.17 operador: Persona autorizada por al menos dos apoderados del Instituto para llevar a cabo órdenes de inversión de los recursos financieros.

4.18 precio limpio: Es el valor presente que se paga por un título sin tener en cuenta los intereses acumulados.

4.19 precio sucio: Es el valor presente que se paga por un título tomando en cuenta los intereses acumulados.

4.20 PREI Inversiones Financieras: Software Institucional en el que se registran y controlan todas las operaciones financieras de inversión por reserva, Fondo Laboral y recursos ajenos que administra la Unidad de Inversiones Financieras y que provee información operativa-contable integral y en línea.

4.21 prospecto de colocación: Documento informativo que establece los términos y características del instrumento financiero a emitir, así como información financiera.

4.22 proveedor de precios: Persona moral cuyo objeto social es la presentación habitual y profesional del servicio de cálculo, determinación y proveeduría o suministro de precios actualizados para valuación de valores, documentos e instrumentos financieros.



4.23 RDO: Reporte Diario de Operación que contiene el detalle de las inversiones liquidadas de los portafolios de las reservas, Fondo Laboral y recursos administrados a cuenta de terceros.

4.24 títulos: Instrumentos financieros con los que se establece jurídicamente la existencia de una deuda monetaria y una obligación de devolución, con un tipo de interés fijo o variable a un plazo predeterminado.

4.25 TRs: Código alfanumérico con el que se identifican los boletos comerciales capturados por la Coordinación de Inversiones en el sistema PREI Inversiones Financieras, el cual contiene la información de las compras y ventas de instrumentos financieros operadas, compuesto por el prefijo TR (Trade Ticket) y un consecutivo de 10 números.

4.26 UDI o UDIS: Unidad de Inversión, que se refiere a los efectos de la inflación que ha sufrido el mercado financiero, los valores los publica el Banco de México a través del Diario Oficial de la Federación o en su página de internet www.banxico.com.mx.

4.27 vector analítico de precios: Archivo electrónico que contiene entre otros los precios limpios y sucios de los activos financieros en circulación, valuados y proporcionados por el proveedor de precios.

5 Políticas

5.1 Generales

5.1.1 El incumplimiento del contenido del presente documento, por las personas servidoras públicas involucradas será causal de las responsabilidades que resulten procedentes conforme a la Ley General de Responsabilidades Administrativas y demás disposiciones aplicables al respecto.

5.1.2 El personal realizará sus labores con apego al Código de Conducta y de Prevención de Conflictos de Interés de las Personas Servidoras Públicas del IMSS, con los principios constitucionales de legalidad, honradez, lealtad, imparcialidad y eficiencia; a través de las pautas de conducta de: buen trato y vocación de servicio; respeto a los derechos humanos y a la igualdad y no discriminación; integridad y prevención de conflictos de interés en el uso del cargo y en la asignación de recursos públicos; y superación personal y profesional, aprobado por el Consejo Técnico mediante Acuerdo: ACDO.SA2.HCT.251121/319.P.DA, de fecha 25 de noviembre de 2021.

5.1.3 La aplicación del presente procedimiento es precondition para ejecutar lo que establece el "Procedimiento para el registro contable de las operaciones de inversión" clave 6A10-003-007.



5.1.4 La entrada en vigor del presente documento deja sin efecto al “Procedimiento para la integración, registros y conciliación contable de las operaciones de inversión”, clave 6A10-003-004, con fecha de registro 6 de noviembre de 2018.

5.2 Específicas

5.2.1 La Coordinación de Control de Operaciones, a través de la División de Registros y Control Operativo, será la responsable de interpretar el presente procedimiento, así como de resolver los casos especiales y los no previstos en éste.

5.2.2 La División de Registros y Control Operativo contará con el expediente físico de la póliza, proporcionado por la División de Confirmaciones y Liquidaciones, el cual respalda los movimientos y las operaciones de inversiones financieras del Instituto realizadas en el día.



Responsable	Descripción de actividades
<p>6 Descripción de actividades</p> <p>División de Registros y Control Operativo</p>	<p style="text-align: center;">ETAPA I</p> <p style="text-align: center;">Revisión de tasas y fechas de cupón de las operaciones financieras</p> <ol style="list-style-type: none">1. Genera por la mañana el “RDO” en “PREI Inversiones Financieras”, de conformidad con las “Instrucciones de operación para la generación del RDO”, clave 6A10-005-001 (Anexo 1), para identificar diariamente los DMs con futuros cortes de cupón a vencer. <p>NOTA: El RDO se genera con fecha del día en revisión.</p> <ol style="list-style-type: none">2. Utiliza el “Vector analítico de precios” en el formato de hoja de cálculo recibido por “Correo electrónico” el día hábil anterior por parte del Proveedor de Precios el cual contiene las tasas de interés y fechas de pago de cupones.3. Pega el “RDO” y el “Vector analítico de precios” en el archivo con formato de hoja de cálculo llamado “Revisión de tasas y fechas cupón DDMMAA”, en las pestañas “RDO_1” y “Vector”, respectivamente.4. Identifica aquellos DMs a los que se habrá de capturar o actualizar tasa, así como la fecha de cupón.5. Ingresa al sistema “PREI Inversiones Financieras” y de conformidad con las “Instrucciones de operación para la carga de tasas y actualización de fechas” clave 6A10-005-002, (Anexo 2), actualiza las tasas y fechas de cupón a los DMs correspondientes.6. Genera nuevamente el “RDO” en “PREI Inversiones Financieras”, de conformidad con las “Instrucciones de operación para la generación del RDO”, clave 6A10-005-001 (Anexo 1).7. Pega el “RDO” en el archivo con formato de hoja de cálculo llamado “Revisión de tasas y fechas cupón DDMMAA”, y verifica que todos los DMs tengan su fecha y tasa de cupón actualizada. <p style="text-align: center;">ETAPA II</p> <p style="text-align: center;">Revisión de intereses cobrados en el custodio de valores</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>8. Genera el “RDO” en “PREI Inversiones Financieras”, de conformidad con las “Instrucciones de operación para la generación del RDO”, clave 6A10-005-001 (Anexo 1), e identifica diariamente los intereses cobrados por vencimiento de inversiones, cortes de cupón, amortización parcial de operaciones en UDIS o moneda extranjera, dividendos y/o ventas títulos o acciones de instrumentos financieros.</p> <p>NOTA: El RDO se genera con fecha de un día hábil antes al día en revisión.</p> <p>9. Descarga, del Portal de internet del custodio de valores en formato de hoja de cálculo, el “Reporte de derechos aplicados” del día en revisión.</p> <p>NOTA: En caso de que exista cobro por ventas de títulos o acciones de instrumentos financieros, se debe descargar también el "Reporte diario de efectivo".</p> <p>10. Obtiene del portal de Banxico las UDIS de la última quincena.</p> <p>11. Pega el “RDO”, el “Reporte de Derechos Aplicados”, el "Reporte Diario de Efectivo" y las UDIS, en el formato de hoja de cálculo denominado “Revisión intereses cobrados DDMMAA”, en las pestañas “RDO”, “Custodio Derechos”, “Reporte Efectivo” y “UDIS”, respectivamente.</p> <p>12. Verifica, en el formato de hoja de cálculo denominado “Revisión intereses cobrados DDMMAA”, que los importes cobrados del “RDO” coincidan contra el “Reporte de derechos aplicados” y el "Reporte diario de efectivo".</p> <p style="text-align: center;">No coincide la información</p> <p>13. Identifica el problema y solicita aclaración y corrección a la División de Confirmaciones y Liquidaciones vía “Correo electrónico”.</p> <p>14. Recibe de la División de Confirmaciones y Liquidaciones, vía “Correo electrónico”, la aclaración del problema.</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>15. Corrige el problema en formato de hoja de cálculo denominado “Revisión intereses cobrados DDMMAA”.</p> <p>Continúa con la actividad 12.</p> <p style="text-align: center;">Si coincide la información</p> <p>Continúa con la actividad 16.</p> <p style="text-align: center;">ETAPA III</p> <p style="text-align: center;">Revisión de compras de títulos o acciones de instrumentos financieros</p> <p>16. Identifica diariamente, en el “RDO” (generado en la actividad 6), los DMs de las compras en directo de títulos o acciones de instrumentos financieros a plazo que se estén liquidando en el día en revisión.</p> <p>17. Recibe de la División de Confirmaciones y Liquidaciones el “Expediente” físico de la póliza del día, el cual incluye entre otros documentos, las cartas confirmación de las compras en directo de títulos o acciones de instrumentos financieros.</p> <p>18. Obtiene, en caso de que aplique con base en el instrumento financiero adquirido, el prospecto de colocación u oferta pública, misma que puede ser descargada del portal de internet de la Bolsa Mexicana de Valores y/o del Proveedor de Precios.</p> <p>19. Revisa los DMs capturados por la División de Confirmaciones y Liquidaciones en “PREI Inversiones Financieras” contra la “Documentación de las compras de títulos o acciones de instrumentos financieros”.</p> <p>NOTA: La “Documentación de las compras en directo de títulos o acciones de instrumentos financieros” se refiere a:</p> <ul style="list-style-type: none">- Las cartas de confirmación recibidas en la actividad 17 anterior.- prospecto de colocación u oferta pública obtenido en la actividad 18 anterior.- “Vector analítico de precios” en formato de hoja de cálculo recibido en la actividad 2 anterior. <p style="text-align: center;">No es correcta la captura</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>20. Identifica el problema y solicita aclaración y corrección a la División de Confirmaciones y Liquidaciones vía “Correo electrónico”.</p> <p>21. Recibe de la División de Confirmaciones y Liquidaciones, vía “Correo electrónico”, la aclaración y resolución del problema.</p> <p>Continúa con la actividad 19.</p> <p style="text-align: center;">Si es correcta la captura</p> <p>Continúa con la actividad 22.</p> <p style="text-align: center;">ETAPA IV</p> <p style="text-align: center;">Revisión de Precios de los Mandatos de Inversión</p> <p>22. Recibe todos los días, vía “Correo electrónico”, el archivo “Interfaz a riesgos” por parte de la División de Confirmaciones y Liquidaciones.</p> <p>23. Identifica en el archivo “Interfaz a riesgos” las líneas correspondientes a la información de los mandatos de inversión.</p> <p>24. Copia del archivo “Interfaz a riesgos” la información de los mandatos de inversión y la pega en el formato de hoja de cálculo “Revisión de Precios de los Mandatos DDMMAA”, en la sección “INTERFAZ” para revisar el precio del día de cada mandato.</p> <p>25. Ejecuta en el sistema “PREI Inversiones Financieras”, la consulta <code>IMDM_PRECIOS_MANDATOS_XFECHA</code> para generar el archivo en formato de hoja de cálculo correspondiente con los precios de los mandatos de inversión determinados por el sistema.</p> <p>NOTA: El sistema “PREI Inversiones Financieras” determina los precios de los mandatos de inversión con base en los layouts de mandatarios que carga todos los días la División de Confirmaciones y Liquidaciones, el cual contiene la composición a detalle de cada mandato, incluyendo los precios sucios de mercado del cierre del día.</p> <p>26. Pega los precios de los mandatos de inversión en formato de hoja de cálculo “Revisión de Precios de los Mandatos DDMMAA”, en la sección “PRECIO SISTEMA”.</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>27. Verifica que no exista diferencia entre los precios de los mandatos de inversión determinados por el sistema "PREI de Inversiones Financieras" y el cálculo en el formato de hoja de cálculo "Revisión de Precios de los Mandatos DDMMAA".</p> <p style="text-align: center;">No coinciden los precios</p> <p>28. Identifica el problema y solicita aclaración y corrección a la División de Confirmaciones y Liquidaciones vía "Correo electrónico".</p> <p>29. Recibe de la División de Confirmaciones y Liquidaciones, vía "Correo electrónico", la aclaración y resolución del problema.</p> <p>Continúa con la actividad 25.</p> <p style="text-align: center;">Si coinciden los precios</p> <p>Continúa con la actividad 30.</p> <p style="text-align: center;">ETAPA V Ventas de Títulos o Acciones de Instrumentos Financieros</p> <p>30. Verifica si se va a realizar el cálculo de utilidad o pérdida contable o en su caso el registro de ventas operadas.</p> <p style="text-align: center;">Modalidad A V.1 Cálculo de utilidad o pérdida contable</p> <p>Continúa con la actividad 31.</p> <p style="text-align: center;">Modalidad B V.2 Registro de ventas operadas</p> <p>Continúa con la actividad 37.</p> <p style="text-align: center;">Modalidad A V.1 Cálculo de utilidad o pérdida contable</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>31. Recibe “Correo electrónico” de la Coordinación de Inversiones, con la solicitud del cálculo de la utilidad por las probables ventas.</p> <p>32. Genera el “RDO” en el “PREI Inversiones Financieras”, de conformidad con las “Instrucciones de operación para la generación del RDO”, clave 6A10-005-001 (Anexo 1), y revisa lo siguiente:</p> <ul style="list-style-type: none">a) Los DMs solicitados para venta deberán estar liquidados y con el estatus de abiertas en el sistema “PREI-Inversiones Financieras”.b) La Coordinación de Inversiones haya proporcionado los siguientes datos para cada DM:<ul style="list-style-type: none">• Portafolio.• DM.• Fecha de Pactación y Fecha Liquidación.• Tipo de Valor, Emisión y Serie.• Número de títulos a vender.• Precio sucio y precio limpio de venta.• En caso de ser en dólares, el tipo de cambio estimado.c) La información de los DMs solicitados coincida contra los datos del RDO. <p style="text-align: center;">No es correcta la información</p> <p>33. Envía “Correo electrónico” a la Coordinación de Inversiones, indicando las inconsistencias y/o la información faltante para poder determinar la utilidad o pérdida contable.</p> <p>34. Recibe “Correo electrónico” de la Coordinación de Inversiones, donde notifican la resolución de las inconsistencias y/o envió de la información faltante.</p> <p>Continúa con la actividad 32.</p> <p style="text-align: center;">Si es correcta la información</p> <p>35. Calcula el valor contable y la utilidad o pérdida contable por la posible venta de cada DM en el formato de hoja de cálculo “Cálculo utilidad contable ventas”.</p>



Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>36. Responde el “Correo electrónico” a la Coordinación de Inversiones con el resultado obtenido de la utilidad o perdida contable de las probables ventas, indicando por cada DM lo siguiente:</p> <ul style="list-style-type: none">• Portafolio.• DM.• Tipo de Valor, Emisión y Serie.• Número de títulos.• Importe de Venta en pesos.• Utilidad o perdida contable en pesos. <p>Y concluye procedimiento.</p> <p style="text-align: center;">Modalidad B V.2 Registro de ventas operadas</p> <p>37. Recibe dos correos electrónicos por parte de la Coordinación de Inversiones:</p> <ol style="list-style-type: none">a) Uno con el archivo “Blotter.xls” en formato de hoja de cálculob) Otro con los TRs de Venta de las ventas operadas. <p>38. Genera el “RDO” en el “PREI Inversiones Financieras”, de conformidad con las “Instrucciones de operación para la generación del RDO”, clave 6A10-005-001 (Anexo 1), y revisa lo siguiente:</p> <ol style="list-style-type: none">a) Los DMs vendidos deberán estar liquidados y con el estatus de abiertas en el sistema “PREI-Inversiones Financieras”.b) Los TRs hayan sido capturados como “Venta/Recompra”.c) Los TRs contengan los siguientes campos capturados de forma completa y correcta:<ul style="list-style-type: none">• Fecha de transacción• Fecha liquidación• Tasa• Importe de venta• Tipo valor• Títulos a vender• Medio de cierre• Acuerdo CIF• Hora negociación (24, 48, 72 hrs.)• Emisión• Precio limpio• Precio sucio• Tasa compra• Hora cierre• Operador• Cartera• Entidad contratante• En la descripción: indicar los DMs que se venderán e indicar si es venta total o parcial.d) La información de las ventas del archivo “Blotter.xls” coincida contra la de los TRs.

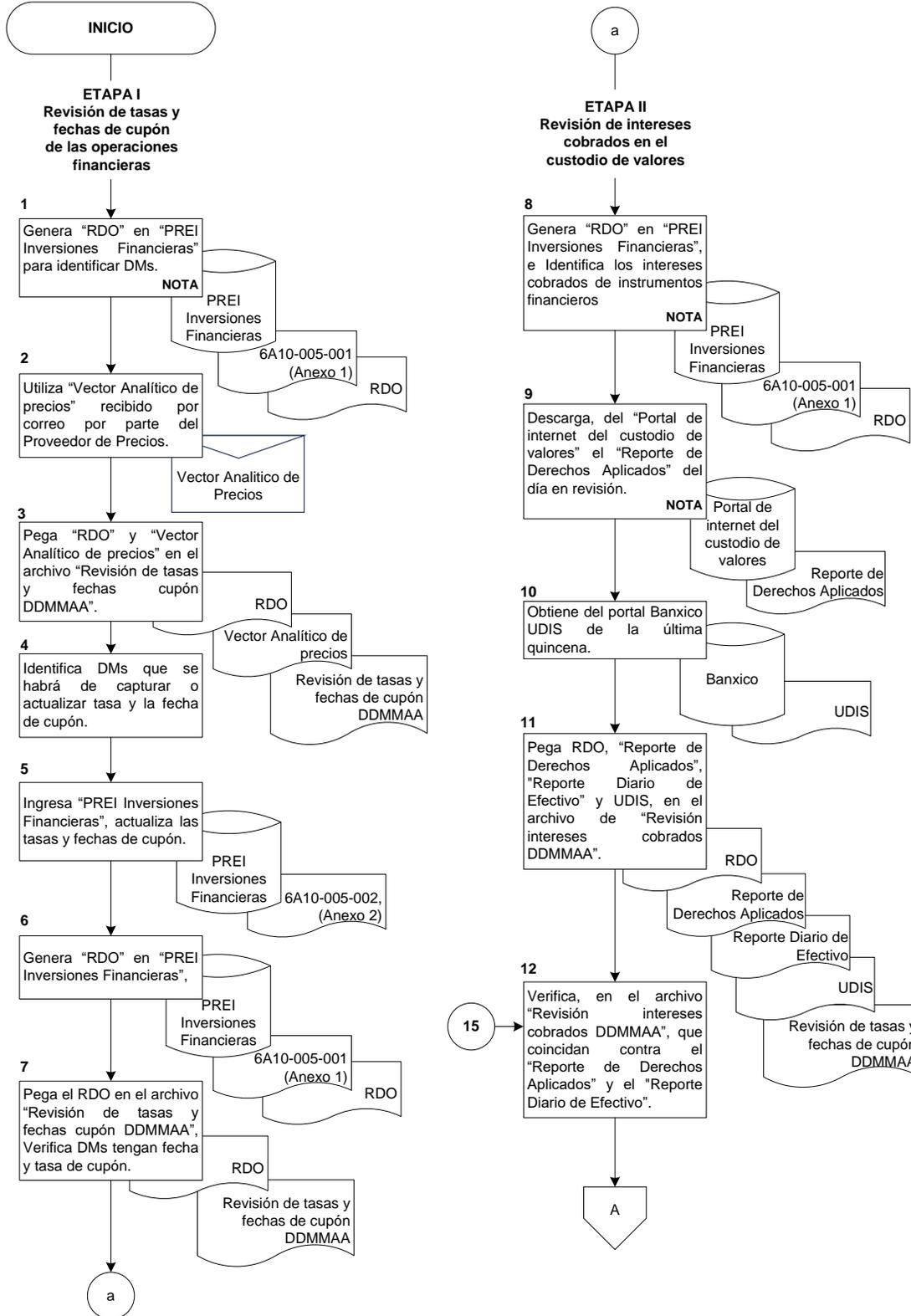


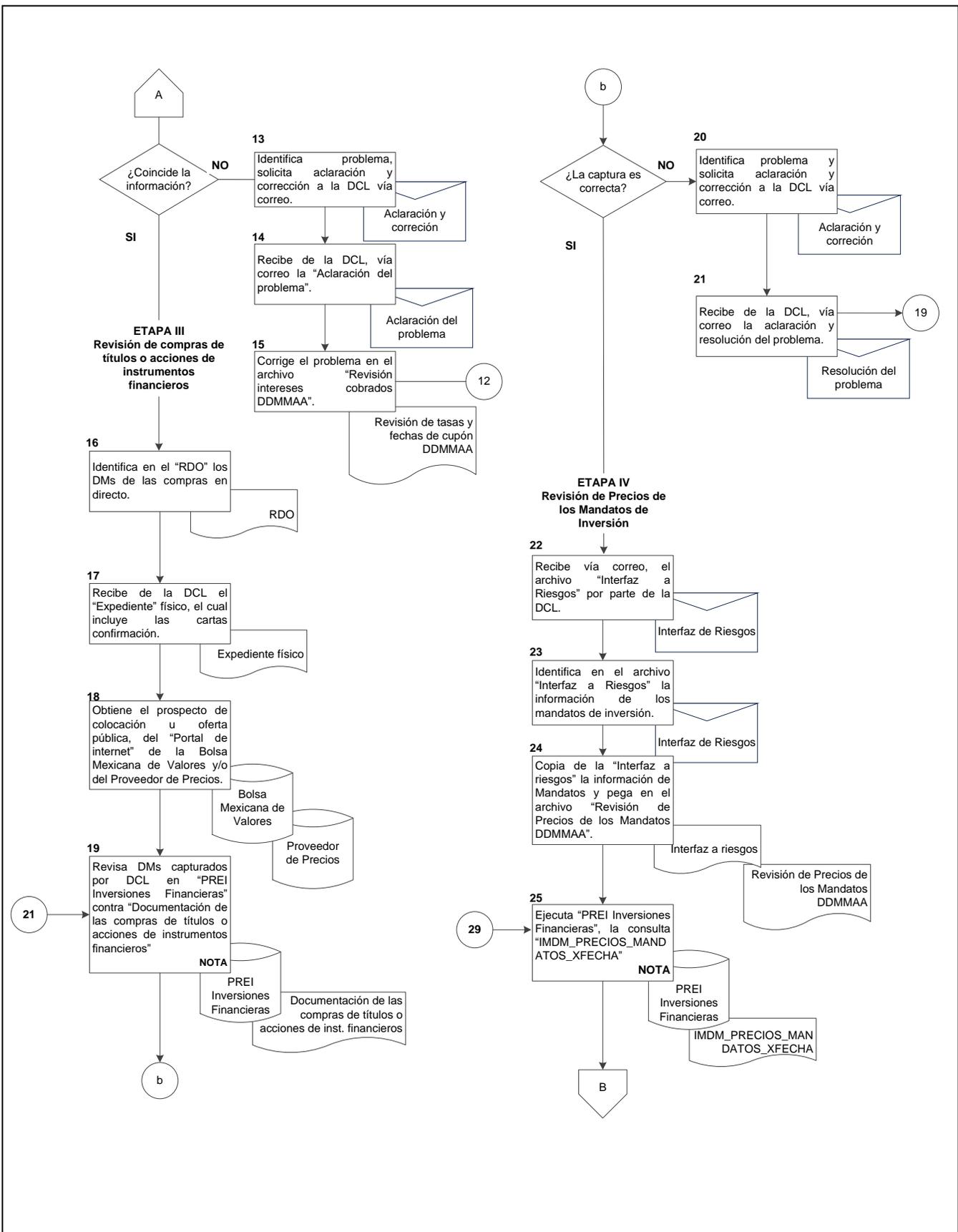
Responsable	Descripción de actividades
División de Registros y Control Operativo	<p>e) La información de los DMs contenida en los TRs, coincida contra los datos del RDO.</p> <p style="text-align: center;">No es correcta la información</p> <p>39.Envía “Correo electrónico” a la Coordinación de Inversiones indicando las inconsistencias y/o la información faltante, y solicita que en caso de ser necesario capture nuevos TRs de venta para poder capturar las ventas en el sistema “PREI Inversiones Financieras”.</p> <p>40.Recibe “Correo electrónico” por parte de la Coordinación de Inversiones, indicando la atención de las inconsistencias y/o la información faltante.</p> <p>Continúa con la actividad 38.</p> <p style="text-align: center;">Si es correcta la información</p> <p>41.Calcula el valor contable y la utilidad o pérdida contable por cada DM de las ventas pactadas, en formato de hoja de cálculo “Ventas DDMMAA”.</p> <p>42.Ingresa al sistema “PREI Inversiones Financieras” y captura los datos para la venta de cada DM, de conformidad con las “Instrucciones para la captura de ventas”, clave 6A10-005-003 (Anexo 3).</p> <p>43.Responde el “Correo electrónico” a la Coordinación de Inversiones y a la División de Confirmaciones y Liquidaciones, con copia al titular de la UIF, en el que informa que las ventas se realizaron en el sistema “PREI Inversiones Financieras” e indica el resultado de la utilidad o pérdida contable por las ventas operadas, indicando por DM lo siguiente:</p> <ul style="list-style-type: none">a) Portafolio.b) DM.c) Tipo de valor, emisión y serie.d) Número de títulos.e) Importe de venta en pesos.f) Utilidad o pérdida contable en pesos, señalando las utilidades con cifras positivas y las pérdidas con cifras negativas.g) DM hija en caso de haber sido venta parcial. <p style="text-align: center;">Fin del procedimiento</p>

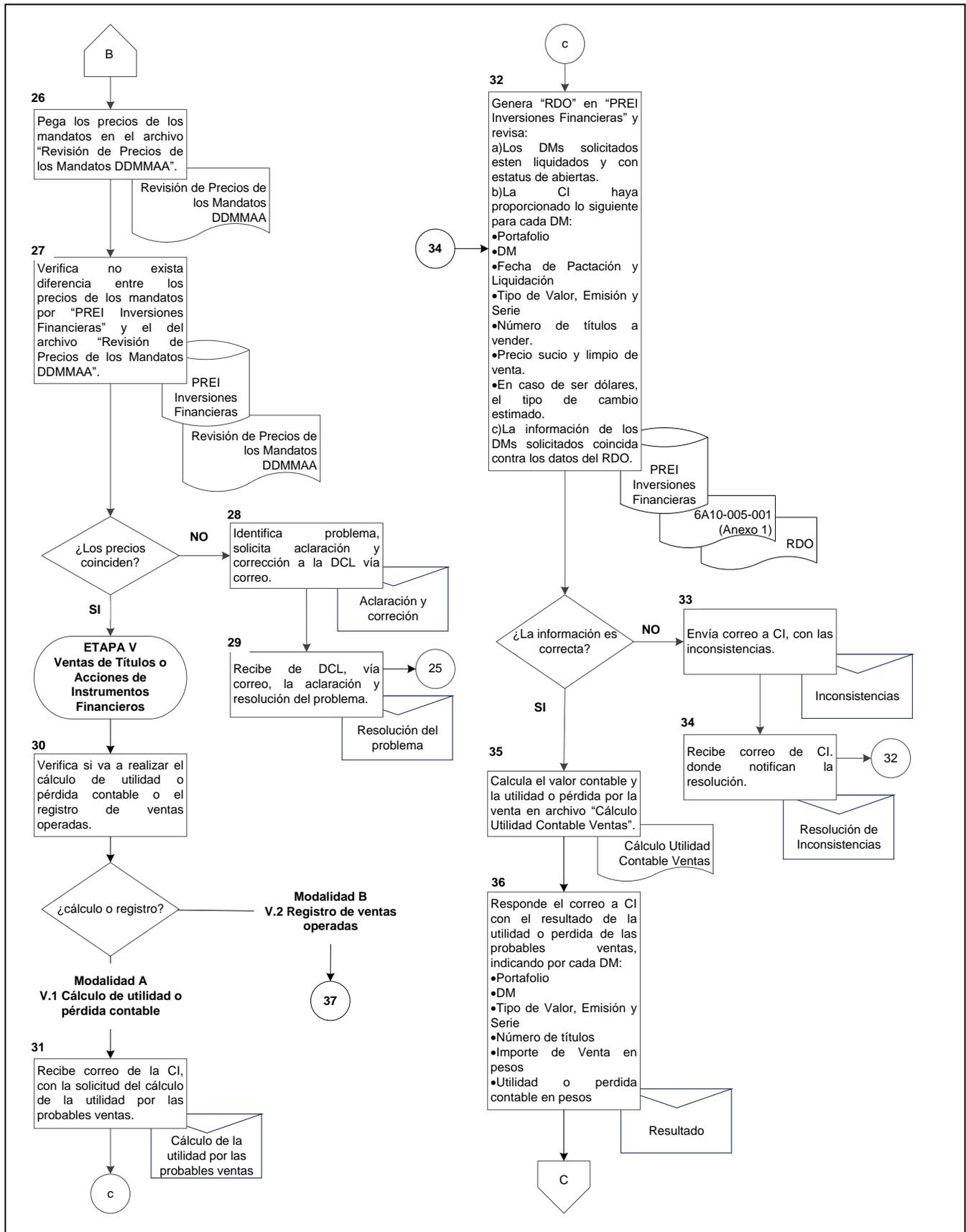


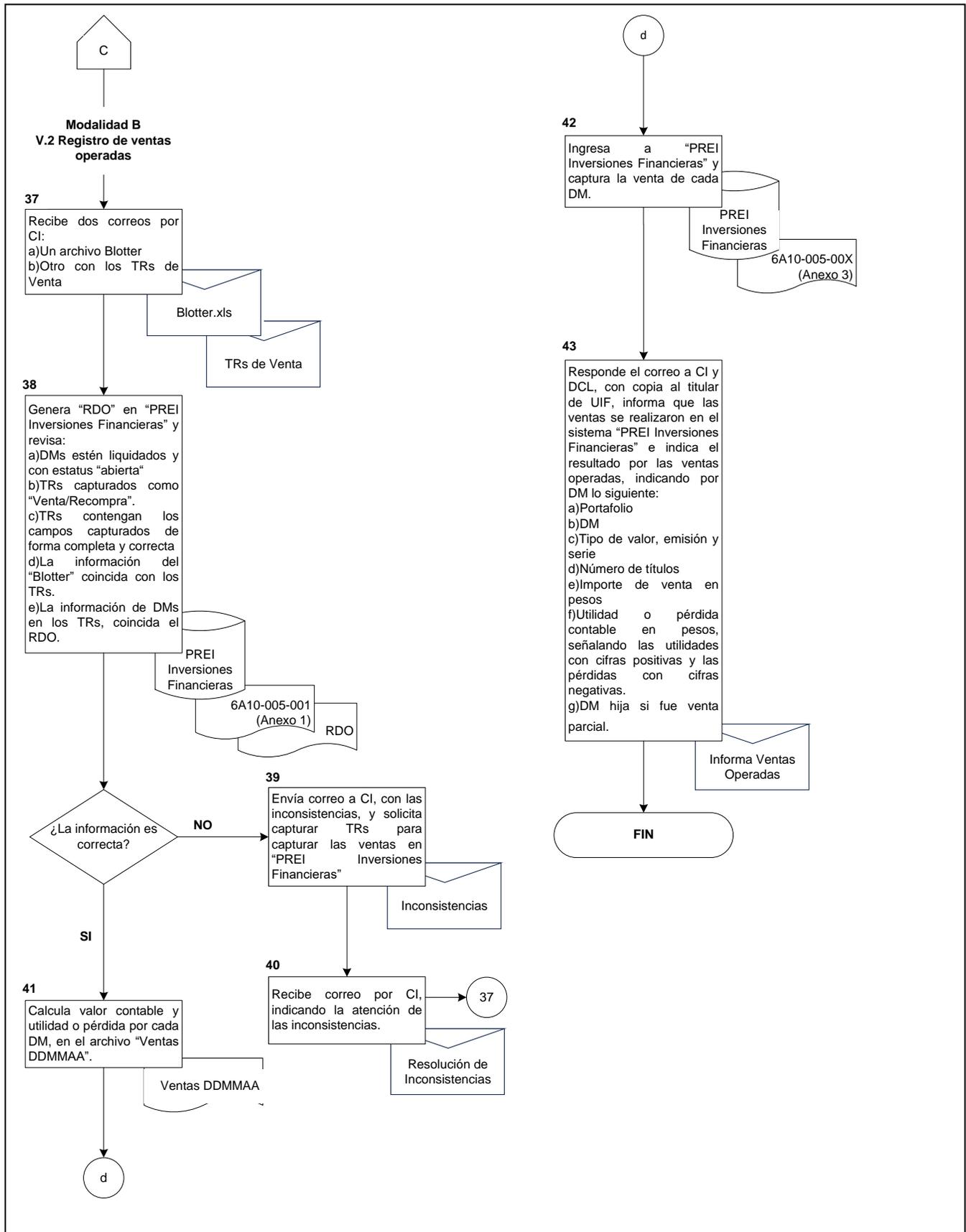
7

Diagrama de flujo











ANEXO 1

**Instrucciones de operación para la generación del RDO
6A10-005-001**



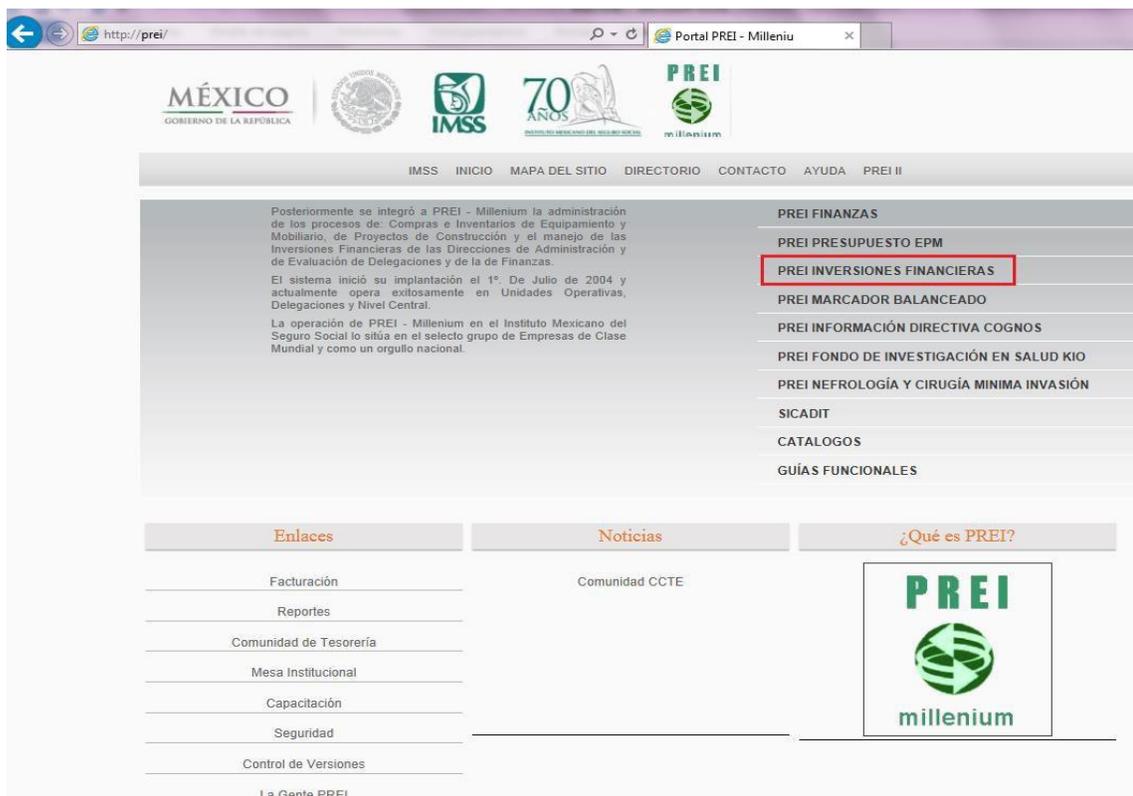
Instrucciones de operación para la generación del RDO

El RDO contiene la posición actualizada al día de ejecución de cada una de las reservas y Fondo Laboral a cargo de la Unidad. Dicho reporte muestra el detalle pormenorizado de cada operación vigente.

1. Ingresar a Internet y capturar la siguiente ruta y presionar *Enter*.



2. En la pantalla que se despliega dar clic en la opción **PREI INVERSIONES FINANCIERAS** del listado que se encuentra del lado derecho de la pantalla.





3. Ingresar al sistema con ID Usuario y Contraseña previamente asignados por CCO y laDIDT y dar clic en: **Conexión**

4. Dirigirse a la ruta:



5. Aparece la siguiente pantalla y presionar el botón: **Buscar**



6. Se muestran la lista de los **ID Control Ejecución** Seleccionar el control de ejecución **RDO** y dar clic en el mismo.

En caso de ser usuario nuevo se deberá añadir un valor *ID Control Ejecución*.

The screenshot shows the Oracle 'Reporte Diario de Operación' search interface. At the top, there are navigation tabs: 'Favoritos', 'Menú Principal', 'Gestión de Oper. Financieras', 'Interfaces', and 'Reporte Diario de Operación'. Below this is the title 'Reporte Diario de Operación' and a search instruction: 'Introduzca los datos que tenga y pulse Buscar. Deje los campos en blanco p[ro]bttener todos los valores'. There are two buttons: 'Buscar un Valor' and 'Añadir un Valor'. A text field contains 'Número máximo de filas para recuperar (hasta 300): 300'. Below that is a dropdown menu for 'ID Control Ejecución' with 'Comienza por' selected. A checkbox for 'Distinguir Mayús/Minús' is present. At the bottom of the search section are buttons for 'Buscar', 'Borrar', 'Búsqueda Básica', and 'Guardar Criterios Búsqueda'. The 'Resultados Búsqueda' section shows a table with columns 'ID Control Ejecución' and 'Código Idioma'. The first row is 'CONTABILIZACION AUTOMATICA' with 'Español'. The second row is 'Intereses x cobrar' with 'Español'. The third row is 'RDO' with 'Español', which is highlighted with a red box. Below it are rows for 'RDO 1', 'RDO 2', 'RDO 3', 'RDO 4', and 'RDO 5', all with 'Español' as the language. At the bottom of the results section are buttons for 'Buscar un Valor' and 'Añadir un Valor'.

7. Aparece la siguiente pantalla. Cambiar la fecha en el campo *Fecha a procesar* y dar clicen el botón:

Ejec

The screenshot shows the Oracle 'Reporte Diario de Operación' execution screen. At the top, there are navigation tabs: 'Favoritos', 'Menú Principal', 'Gestión de Oper. Financieras', 'Interfaces', and 'Reporte Diario de Operación'. Below this is the title 'Reporte Diario de Operación'. The 'ID Ctrl Ejec:' field contains 'RDO'. To the right are links for 'Gestor Informes' and 'Monitor Procesos', and a button labeled 'Ejec' which is highlighted with a red box. Below this is the 'Parámetros de ejecución' section. The 'Unidad Negocio' field contains 'IMSSR'. The 'Fecha a procesar' field contains '24/02/2016' and is highlighted with a red box. Below this is the 'Excepciones de Litigio' section, which is currently empty. Below that is the 'Excepciones con Interes Capitalizable' section, which contains a table with columns 'ID Oper Fnc' and 'Descripción'. The table has 4 rows: 1. 'DM0000078328' with '9.8 años a 2022-09-12 inversión MXN 30.263m. @ TIIE 91'; 2. 'DM0000078329' with '9.8 años a 2022-09-12 Inversión MXN 30.263m. @ TIIE 91'; 3. 'DM0000078330' with '9.8 años a 2022-09-12 inversión MXN 8.235m. @ 4%'; 4. 'DM0000078331' with '9.8 años a 2022-09-12 inversión MXN 8.235m. @ 4%'. Below this is the 'Portafolio' section, which contains a table with columns 'Cartera' and 'Descripción'. The table has 3 rows: 1. 'C 85-89' with 'CLAUSULA 85-89'; 2. 'FOFOE' with 'FONDO FOMENTO A LA EDUCACIÓN'; 3. 'FOMENZA' with 'FOMENTO PARA LA ENSEÑANZA'.

6A10-005-001



8. Se muestra la siguiente pantalla. Seleccionar de la Lista Procesos la casilla RDO y Nombre Proceso IMDM_RDO, verificando que en la columna *Tipo este seleccionado Web y en *Formato sea CSV, y dar clic en:

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper. Financieras > Interfases > Reporte Diario de Operación

Petición Gestor Procesos

ID Usuario: IVILLASENOR09 ID Ctrl Ejec: RDO

Nombre Servidor: PSUNX Fecha Ejec: 24/02/2016
Recurrencia: Recurrencia Hora Ejec: 10:38:00a.m. Restablecer a F/H Actual

Huso Horario:

Selec	Descripción	Nombre Proceso	Tipo Proceso	*Tipo	*Formato	Distribución
<input checked="" type="checkbox"/>	Reporte Diario de Operación	IMDM_RDO	Proceso SQR	Web	CSV	Distribución
<input type="checkbox"/>	Resumen del RDO	RDM_RRDO	Crystal	Web	PDF	Distribución

Aceptar Cancelar Actualizar

9. Aparece la siguiente pantalla con la Instancia Proceso. Dar clic en [Monitor Procesos](#)

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper. Financieras > Interfases > Reporte Diario de Operación

Reporte Diario de Operación

ID Ctrl Ejec: RDO Gestor Informes **Monitor Procesos** Ejec

Instancia Proceso:139217

Parámetros de ejecución

Unidad Negocio: IMSSR Fecha a procesar: 24/02/2016

Excepciones de Litigio

Personalizar | Buscar | Primero 1 de 1 Último

10. Aparece la siguiente pantalla, misma que muestra en la columna [Estado Ejec](#) y [Estado Distribución](#), En Cola y N/A respectivamente, se presiona [Actualizar](#) repetidas veces hasta que en las columnas antes mencionadas indique Correcto y Enviado respectivamente, lo cual indicará que el proceso ha concluido satisfactoriamente. Finalmente dar clic en [Detalles](#)

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > PeopleTools > Gestor de Procesos > Monitor de Procesos

Lista de Procesos | Lista de Servidores

Consulta Peticiones Proceso

Usuario: IVILLASENOR09 Tipo: Último 5 Días Actualizar

Servidor: Nombre: Instancia: A

Estado Ejec: Estado Distribución: Guardar al Actualizar

Selec	Instancia	Nº Secuencia Job	Tipo Proceso	Nombre	Usuario	Fecha/Hora Ejec	Estado Ejec	Estado Distribución	Detalles
<input type="checkbox"/>	139217		Proceso SQR	IMDM_RDO	IVILLASENOR09	24/02/2016 10:43:33a.m. PST	Correcto	Enviado	Detalles



11. Aparece la siguiente pantalla. Dar clic en [Registro/Rastreo](#)

ORACLE

Favoritos Menú Principal > Gestión de Oper. Financieras > Interfaces > Reporte Diario de Operación

Detalle Proceso

Proceso

Instancia:	139217	Tipo:	Proceso SQR
Nombre:	IMDM_RDO	Descripción:	Reporte Diario de Operación
Estado Ejec:	Correcto	Estado Distribución:	Enviado

Ejecución

ID Control:	RDO
Ubicación:	Servidor
Servidor:	PSUNX
Recurrencia:	

Proceso Actualización

- Retener Petición
- Poner Petición en Cola
- Cancelar Petición
- Eliminar Petición
- Reiniciar Petición

Fecha/Hora

Fecha/Hora Petición:	24/02/2016 10:43:34a.m. PST
Ejecutar Después de:	24/02/2016 10:43:33a.m. PST
Inicio Proceso:	24/02/2016 10:43:46a.m. PST
Fin Proceso:	24/02/2016 10:44:45a.m. PST

Acciones

[Parámetros](#) Transferir

[Req Mensales](#)

Tiempos Batch

[Registro/Rastreo](#)

Aceptar Cancelar

12. Aparece la siguiente pantalla. De la [Lista Archivos](#) dar clic en el archivo [RDO 1.csv](#)

ORACLE

Favoritos Menú Principal > Gestión de Oper. Financieras > Interfaces > Reporte Diario de Operación

Registro/Rastreo

Informe

ID Informe:	112331	Instancia Proceso:	139217	Req Mensales
Nombre:	IMDM_RDO	Tipo Proceso:	SQR Process	
Estado Ejec:	Correcto			

Reporte Diario de Operación

Detalles Distribución

Nodo Distribución:	HTTPS	F Vencimiento:	25/03/2016
--------------------	-------	----------------	------------

Lista Archivos

Nombre	Tamaño Archivo (bytes)	Fecha/Hora Creación
RDO 1.csv	554,354	24/02/2016 10:44:45.115390a.m. PST
SQR_IMDM_RDO_139217.log	1,755	24/02/2016 10:44:45.115390a.m. PST
imdm_rdo_139217.out	403	24/02/2016 10:44:45.115390a.m. PST

Distribuir a

Tipo ID Distribución	ID Distribución
Usuario	IVILLASENOR09

Volver

6A10-005-001



13. Aparece el RDO, el cual se guardará en una carpeta en Excel.

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P	Q	
	OperFin	Fecha del RC Portafolio	Descripción	Entidad Cont	Clase y Subcl	Posición	Fec Operaci	Fec Vencimi	Plazo	Pactad No.	Titulos	Monto Inver	Intereses co	Tasa	Fec Ini cupó	Fec Fin cupó	Días transcur	Emis
2	DM00000001	24/02/2016	RJP52A	9.2 años a 20	Bancomer	GUBTRINAC	1	25/09/2007	15/12/2016	3,369	250,000	#####	0	7.25	17/12/2015	16/06/2016	69	BONK
3	DM00000001	24/02/2016	RJP52A	19.7 años a 2	IXE CASA DE	GUBTRINAC	1	25/09/2007	03/06/2027	7,191	250,000	#####	0	7.5	17/12/2015	16/06/2016	69	BONK
4	DM00000001	24/02/2016	RJP52A	19.7 años a 2	Bancomer	GUBTRINAC	1	25/09/2007	03/06/2027	7,191	250,000	#####	0	7.5	17/12/2015	16/06/2016	69	BONK
5	DM00000001	24/02/2016	RJP52A	19.7 años a 2	Barclays Ban	GUBTRINAC	1	27/09/2007	03/06/2027	7,189	300,000	#####	0	7.5	17/12/2015	16/06/2016	69	BONK
6	DM00000001	24/02/2016	RJP52B	9.1 años a 20	IXE CASA DE	GUBTRINAC	1	15/11/2007	15/12/2016	3,318	300,000	#####	0	7.25	17/12/2015	16/06/2016	69	BONK
7	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	28.2 años a 2	Barclays Ban	GUBTRINAC	1	13/09/2007	22/11/2035	10,297	45,000	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
8	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	18.2 años a 2	Barclays Ban	GUBTRINAC	1	13/09/2007	04/12/2025	6,657	45,000	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
9	DM00000002	24/02/2016	RJP52B	17.6 años a 2	IXE CASA DE	GUBTRINAC	1	13/05/2008	04/12/2025	6,414	78,818	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
10	DM00000002	24/02/2016	RJP52B	27.4 años a 2	HSBC	GUBTRINAC	1	09/07/2008	22/11/2035	9,997	25,691	9,967,702.63	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
11	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	28.1 años a 2	Barclays Ban	GUBTRINAC	1	25/10/2007	22/11/2035	10,255	134,700	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
12	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	27.6 años a 2	Merrill Lynct	GUBTRINAC	1	07/05/2008	22/11/2035	10,060	109,043	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
13	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	17.6 años a 2	Merrill Lynct	GUBTRINAC	1	07/05/2008	04/12/2025	6,420	112,022	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
14	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	27.6 años a 2	IXE CASA DE	GUBTRINAC	1	08/05/2008	22/11/2035	10,059	110,100	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
15	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	17.5 años a 2	Vector CB	GUBTRINAC	1	26/05/2008	04/12/2025	6,401	114,271	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
16	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	9.5 años a 20	Merrill Lynct	GUBTRINAC	1	27/06/2008	14/12/2017	3,457	132,555	#####	0	3.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB
17	DM00000002	24/02/2016	RJP52A	27.4 años a 2	Santander M	GUBTRINAC	1	03/07/2008	22/11/2035	10,003	127,500	#####	0	4.5	17/12/2015	16/06/2016	69	UDIB



ANEXO 2

**Instrucciones de operación para la carga de tasas y actualización de fechas
6A10-005-002**

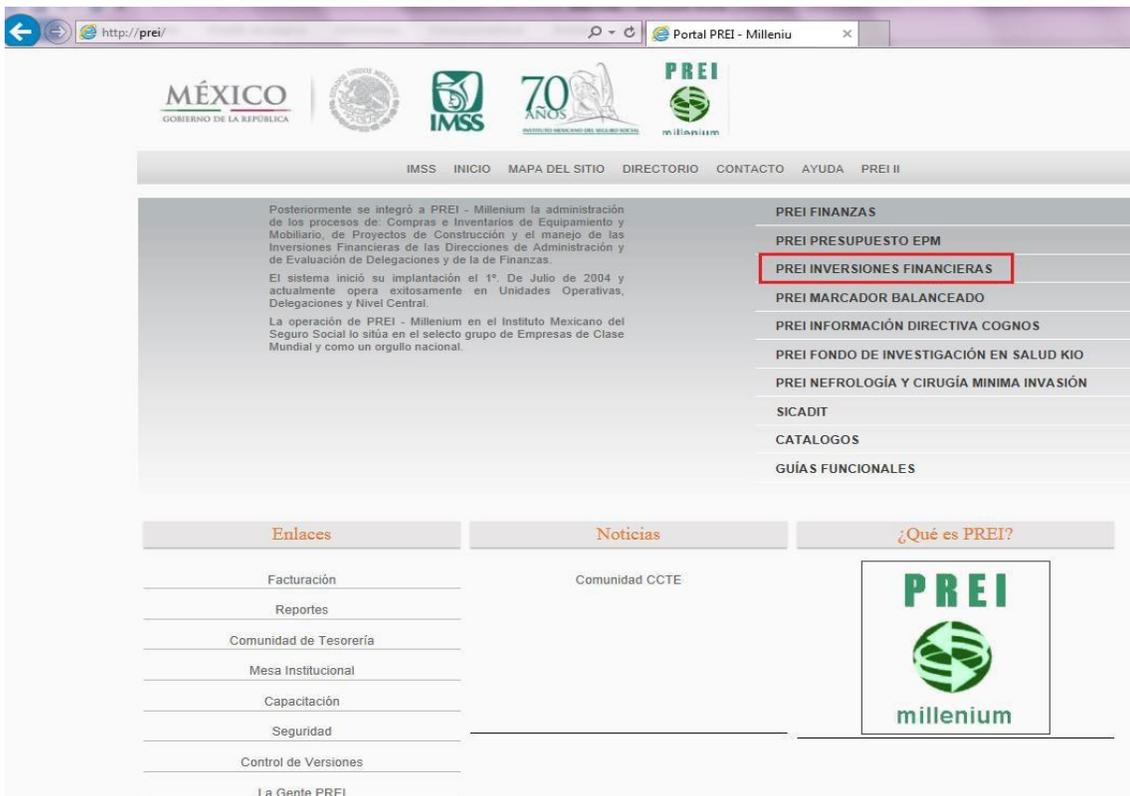


Instrucciones de operación para la carga de tasas y actualización de fechas

1. Ingresar a Internet y capturar la siguiente ruta y presionar *Enter*.



2. En la pantalla que se despliega dar clic en la opción: *PREI INVERSIONES FINANCIERAS*, del listado que se encuentra del lado derecho de la pantalla.





3. Ingresar al sistema con ID Usuario y Contraseña previamente asignados por CCO y laDIDT y dar clic en:

Conexión

4. Dirigirse a la ruta:

Favoritos Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

5. Aparece la siguiente pantalla, digitar en el campo *ID Oper Fnc*: la operación a la cual se le va a cargar tasa y actualizar fecha, y presionar el botón **Buscar**

En caso de ser usuario nuevo se deberá añadir un valor *ID Control Ejecución*.

6A10-005-002



6. Se muestra la pestaña *Detalle Operación Financiera*, desplazarse hacia abajo y dar clic en **Fechas Interés**

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Títulos: 302,357.00 Precio Nominal: 100.00000000

*Valor Nominal: 30,235,700.00 *Moneda: MXN

*Impt Liquidación: 29,999,975.52 *Precio Limpio: 99.16184920

Interés Pedido: 17,696.28 Descuento/Prima: Lineal

Tipo Ajuste Inicial: 3.01000000 Fecha Vencimiento Estimada: [B]

*Mét Amort: Sin Amortización

Fechas y Cálculo Interés

Cartera: RT *Tratamiento Contable: Retdo hasta Vencimiento

Agente: [] *Entd Contratante: 5110 Santander Mexico

Emisor: GOB Garante: GOB

Clasif. Act.: GUBTRVAC Referencia: []

Descripción: 5 años a 2019-08-08 inversión MXN 30.236m. @ TF BAN

Estado Oper Fnc: Abierto Autorizado

Excluir de Posición

Revisión Preliminar

Compen Flj Caja Liqd Oper Fnc

Flujos Caja Prueba Límite Cprb OF Reserva Imprimir

Req Evento Comis Notas Documentos Festivos Adicionales Ofertas Secuencia Documentos

Información Fondo Análisis Oper Fnc Venta/Recompra **Fechas Interés**

Anexos (0)

Guardar Volver a Buscar Notificar Añadir Actualizar/Visualizar

Detalle Operación Financiera | Instrucciones de Liquidación

7. Aparece la pantalla: fecha de intereses y de pago, y dar clic en **Ver Todo**

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Inicio | Lista Trabj | Añadir a Favor

Fechas de Intereses y de Pago

UN: IMSSR ID Oper Fnc: DM0000117752 Linea: 1

Descripción: 5 años a 2019-08-08 inversión MXN 30.236m. @ TF BAN

Personalizar | Buscar **Ver Todos** | # | Primer | 1-10 de 65 | Último

Tipo	F Final Periodo	F Ajuste	Fecha Pago	Sustituir Pago Interés	Importe Pago	Saldo Principal	Tp Ajust	Tipo según Ajuste	Tipo	Pago Interés	Pago Principal	Moneda
Pago Intereses	11/09/2014 [B]	14/08/2014 [B]	11/09/2014 [B]	<input type="checkbox"/>	70,785.13	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.01000000	70,785.13	0.00	MXN
Pago Intereses	09/10/2014 [B]	11/09/2014 [B]	09/10/2014 [B]	<input type="checkbox"/>	70,549.97	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.00000000	70,549.97	0.00	MXN
Pago Intereses	06/11/2014 [B]	09/10/2014 [B]	06/11/2014 [B]	<input type="checkbox"/>	71,020.30	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.02000000	71,020.30	0.00	MXN
Pago Intereses	04/12/2014 [B]	06/11/2014 [B]	04/12/2014 [B]	<input type="checkbox"/>	71,255.47	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.03000000	71,255.47	0.00	MXN
Pago Intereses	31/12/2014 [B]	04/12/2014 [B]	31/12/2014 [B]	<input type="checkbox"/>	69,164.16	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.05000000	69,164.16	0.00	MXN
Pago Intereses	29/01/2015 [B]	31/12/2014 [B]	29/01/2015 [B]	<input type="checkbox"/>	73,800.30	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.03000000	73,800.30	0.00	MXN
Pago Intereses	26/02/2015 [B]	29/01/2015 [B]	26/02/2015 [B]	<input type="checkbox"/>	71,255.47	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.03000000	71,255.47	0.00	MXN
Pago Intereses	26/03/2015 [B]	26/02/2015 [B]	26/03/2015 [B]	<input type="checkbox"/>	71,725.80	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.05000000	71,725.80	0.00	MXN
Pago Intereses	23/04/2015 [B]	26/03/2015 [B]	23/04/2015 [B]	<input type="checkbox"/>	71,725.80	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.05000000	71,725.80	0.00	MXN
Pago Intereses	21/05/2015 [B]	23/04/2015 [B]	21/05/2015 [B]	<input type="checkbox"/>	70,549.97	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.00000000	70,549.97	0.00	MXN

Ajuste Principal

Tipo Pago: [] Importe Principal: []

Fecha Pago: [] Ajustar Principal

6A10-005-002



8. Buscar la fila del Corte de cupón a cargar o actualizar, guiándose en la fecha fin de cupón que indica el “RDO”; y actualizar o cargar la tasa y fecha.

ORACLE

Inicio | Lista Trab | Añadir a Favoritos

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper. Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Nueva Ventana | Personaliz

Fechas de Intereses y de Pago

UN: IMSRR ID Oper Fac: DM0000117752 Línea: 1

Descripción: 5 años a 2019-08-09 inversión MXN 30 236m. @ TF BAN

Personalizar | Buscar | Ver 10 | Primero: 1 | 1 de 65 | Último

Tipo	F Final Periodo	F Ajuste	Fecha Pago	Sustituir Pago Interés	Importe Pago	Saldo Principal	Tp Ajus	Tipo según Ajuste	Tipo	Pago Interés	Pago Principal	Moneda
Intereses	10/08/2015	10/08/2015	10/08/2015	<input type="checkbox"/>	71,255.47	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0300000	71,255.47	0.00	MXN
Pago Intereses	08/10/2015	10/09/2015	08/10/2015	<input type="checkbox"/>	71,490.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0400000	71,490.63	0.00	MXN
Pago Intereses	05/11/2015	08/10/2015	05/11/2015	<input type="checkbox"/>	71,725.80	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0500000	71,725.80	0.00	MXN
Pago Intereses	03/12/2015	05/11/2015	03/12/2015	<input type="checkbox"/>	75,723.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.2200000	75,723.63	0.00	MXN
Pago Intereses	28/01/2016	31/12/2015	28/01/2016	<input type="checkbox"/>	77,134.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.2800000	77,134.63	0.00	MXN
Pago Intereses	25/02/2016	28/01/2016	25/02/2016	<input type="checkbox"/>	77,604.96	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.3000000	77,604.96	0.00	MXN
Pago Intereses	24/03/2016	25/02/2016	24/03/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	21/04/2016	24/03/2016	21/04/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	19/05/2016	21/04/2016	19/05/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	16/06/2016	19/05/2016	16/06/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	14/07/2016	16/06/2016	14/07/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	11/08/2016	14/07/2016	11/08/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	08/09/2016	11/08/2016	08/09/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	06/10/2016	08/09/2016	06/10/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	03/11/2016	06/10/2016	03/11/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN

Ajusto Principal

Tipo Pago: Importe Principal:

Fecha Pago:

Ajustar Principal

Reg Evento

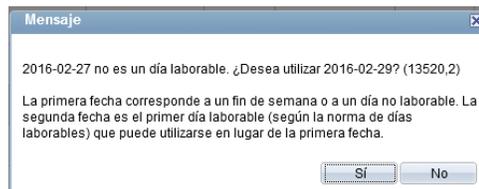
Aceptar Cancelar Aplicar

Actualizar

9. Para actualizar o cargar la tasa y fecha, realizar lo siguiente:

- En caso de que se trate de actualización, deberá cambiar la tasa que tiene el sistema por la correcta en el campo **Tipo**
- En caso de que se trate de carga, deberá:
 - ✓ Habilitar la casilla **Tp Ajus**
 - ✓ Capturar la tasa en el campo **Tipo**
- La fecha fin de cupón (fecha de causación) debe actualizarse en el campo **F Final Periodo** misma que debe ser igual a la indicada en el campo **F Ajuste** de la siguiente fila.

NOTA: en caso que la fecha que capture sea inhábil, el sistema en automático generará el siguiente mensaje, al cual se debe responder NO para conservar la fecha capturada.





Al momento de actualizar la fecha en el campo **F Final Periodo** el sistema actualiza en automático la fecha del campo **Fecha Pago**

NOTA: Cuando la fecha fin de cupón sea inhábil y por lo tanto el pago se realice el día hábil inmediato siguiente, se debe revisar la sección *Periodicidad de pago de los Intereses* del prospecto de colocación:

i. Si el documento indica que los intereses deben calcularse por el número de días efectivamente transcurridos hasta la fecha de pago de intereses, entonces en el campo **F Final Periodo** se debe poner la fecha del día hábil de pago.

ii. Si el documento indica que los días que incluye el cupón no se modificarán, aun cuando el pagó se realiza el día hábil inmediato, en el campo **F Final Periodo** se debe quedar la fecha fin inhábil y en el campo **Fecha Pago** debe capturarse la fecha del día hábil de pago.

Dar clic en el botón

Aplicar

y posteriormente en

Aceptar

ORACLE

Inicio | Lista Trab | Añadir a Favorit

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Nueva Ventana | Personaliz

Fechas de Intereses y de Pago

UN: IMSSR ID Oper Fnc: DM0000117752 Línea: 1

Descripción: 5 años a 2019-08-09 inversión MXN 30.236m. @ TF BAN

Tipo	F Final Periodo	F Ajuste	Fecha Pago	Sustituir Pago Interés	Importe Pago	Saldo Principal	Tp Ajust	Tipo según Ajuste	Tipo	Pago Interés	Pago Principal	Moneda
Intereses	10/09/2015	10/09/2015	10/09/2015	<input type="checkbox"/>	71,255.47	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0300000	71,255.47	0.00	MXN
Pago Intereses	08/10/2015	10/09/2015	08/10/2015	<input type="checkbox"/>	71,490.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0400000	71,490.63	0.00	MXN
Pago Intereses	05/11/2015	08/10/2015	05/11/2015	<input type="checkbox"/>	71,725.80	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.0500000	71,725.80	0.00	MXN
Pago Intereses	03/12/2015	05/11/2015	03/12/2015	<input type="checkbox"/>	75,723.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.2200000	75,723.63	0.00	MXN
Pago Intereses	31/12/2015	03/12/2015	31/12/2015	<input type="checkbox"/>	77,134.63	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.2800000	77,134.63	0.00	MXN
Pago Intereses	25/02/2016	28/01/2016	25/02/2016	<input type="checkbox"/>	77,604.96	30,235,700.00	<input checked="" type="checkbox"/>		3.3000000	77,604.96	0.00	MXN
Pago Intereses	24/03/2016	25/02/2016	24/03/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	21/04/2016	24/03/2016	21/04/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	19/05/2016	21/04/2016	19/05/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	16/06/2016	19/05/2016	16/06/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	14/07/2016	16/06/2016	14/07/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	11/08/2016	14/07/2016	11/08/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	08/09/2016	11/08/2016	08/09/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago Intereses	06/10/2016	08/09/2016	06/10/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN
Pago	02/11/2016	06/10/2016	02/11/2016	<input type="checkbox"/>	0.00	30,235,700.00	<input type="checkbox"/>			0.00	0.00	MXN

Ajuste Principal

Tipo Pago: Importe Principal:

Fecha Pago:

Ajustar Principal

Cancelar Aplicar Actualizar

6A10-005-002



10. Aparece la pestaña *Detalle Operación Financiera* y dar clic en el botón

Flujos Caja

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Títulos: 302,357.00 Precio Nominal: 100.00000000

*Valor Nominal: 30,235,700.00 *Moneda: MXN

*Impt Liquidación: 29,999,975.52 *Precio Limpio: 99.16184920

Interés Pedido: 17,695.28 Descuento/Prima: Lineal

Tipo Ajuste Inicial: 3.01000000 Fecha Vencimiento Estimada: [B]

*Mét Amort: Sin Amortización

Fechas y Cálculo Interés

Cartera: RT *Tratamiento Contable: Retdo hasta Vencimiento

Agente: [] *Entd Contratante: 5110 Santander Mexico

Emisor: GOB Garante: GOB

Clasif. Act.: GUBTRVNAC Referencia: []

Descripción: 5 años a 2019-08-08 inversión MXN 30.236m. @ TF BAN

Estado Oper Fnc: Abierto Autorizado

Excluir de Posición

Revisión Preliminar

Compon Fluj Caja Lqd Oper Fnc

Flujos Caja Prueba Límite Cprb OF Reserva Imprimir

[Req Evento](#) [Comis](#) [Notas Documentos](#) [Festivos Adicionales](#) [Ofertas](#) [Secuencia Documentos](#)

[Información Fondo](#) [Análisis Oper Fnc](#) [Venta/Recompra](#) [Fechas Interés](#)

[Anexos \(0\)](#)

Guardar Volver a Buscar Notificar Añadir Actualizar/Visualizar

Detalle Operación Financiera | Instrucciones de Liquidación

11. Aparecen los flujos de la operación y dar clic en

Volver

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Flujos de Caja

Fecha Liquidación	Descripción	Impte	Moneda	Fecha Nominal	Fecha Interés
21/08/2014	Principal	-29,999,975.52	MXN		
11/09/2014	Interés	70,785.13	MXN	11/09/2014	11/09/2014
09/10/2014	Interés	70,549.97	MXN	09/10/2014	09/10/2014
06/11/2014	Interés	71,020.30	MXN	06/11/2014	06/11/2014
04/12/2014	Interés	71,255.47	MXN	04/12/2014	04/12/2014
31/12/2014	Interés	69,164.16	MXN	31/12/2014	31/12/2014
29/01/2015	Interés	73,800.30	MXN	29/01/2015	29/01/2015
26/02/2015	Interés	71,255.47	MXN	26/02/2015	26/02/2015
26/03/2015	Interés	71,725.80	MXN	26/03/2015	26/03/2015
23/04/2015	Interés	71,725.80	MXN	23/04/2015	23/04/2015
21/05/2015	Interés	70,549.97	MXN	21/05/2015	21/05/2015
18/06/2015	Interés	71,490.63	MXN	18/06/2015	18/06/2015
16/07/2015	Interés	72,431.30	MXN	16/07/2015	16/07/2015
13/08/2015	Interés	72,196.13	MXN	13/08/2015	13/08/2015
10/09/2015	Interés	71,255.47	MXN	10/09/2015	10/09/2015

Volver



ANEXO 3

Instrucciones para captura de ventas
6A10-005-003



Instrucciones para captura de ventas

1. Ingresar a Internet y capturar la siguiente ruta y presionar *Enter*.

2. En la pantalla que se despliega dar clic en la opción **PREI INVERSIONES FINANCIERAS** del listado que se encuentra del lado derecho de la pantalla.

MÉXICO GOBIERNO DE LA REPÚBLICA

IMSS

70 AÑOS INSTITUTO MEXICANO DEL SEGURO SOCIAL

PREI millenium

IMSS INICIO MAPA DEL SITIO DIRECTORIO CONTACTO AYUDA PREI II

Posteriormente se integró a PREI - Millennium la administración de los procesos de: Compras e Inventarios de Equipamiento y Mobiliario, de Proyectos de Construcción y el manejo de las Inversiones Financieras de las Direcciones de Administración y de Evaluación de Delegaciones y de la de Finanzas.

El sistema inició su implantación el 1º. De Julio de 2004 y actualmente opera exitosamente en Unidades Operativas, Delegaciones y Nivel Central.

La operación de PREI - Millennium en el Instituto Mexicano del Seguro Social lo sitúa en el selecto grupo de Empresas de Clase Mundial y como un orgullo nacional.

PREI FINANZAS

- PREI PRESUPUESTO EPM
- PREI INVERSIONES FINANCIERAS**
- PREI MARCADOR BALANCEADO
- PREI INFORMACIÓN DIRECTIVA COGNOS
- PREI FONDO DE INVESTIGACIÓN EN SALUD KIO
- PREI NEFROLOGÍA Y CIRUGÍA MINIMA INVASIÓN
- SICADIT
- CATALOGOS
- GUÍAS FUNCIONALES

Enlaces

- Facturación
- Reportes
- Comunidad de Tesorería
- Mesa Institucional
- Capacitación
- Seguridad
- Control de Versiones
- La Gente PREI

Noticias

- Comunidad CCTE

¿Qué es PREI?

PREI millenium

6A10-005-003



- Ingresar al sistema con ID Usuario y Contraseña previamente asignados por CCO y la DITD.

http://producciondm.imss.gob.mx/psp/ps/??&cmd=login&languageCd=ESP

IMSS DIGITAL Deal Management
Inversiones Financieras (DM)

ID Usuario:
Contraseña:
Conexión

- Seleccionar la ruta que se muestra en la pantalla al calce, capturando la unidad de negocio "IMSSR", el DM a vender en el campo ID Oper Fnc y dar clic en

ORACLE

Favoritos | Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Operaciones Financieras

Introduzca los datos que tenga y pulse Buscar. Deje los campos en blanco p/obtener todos los valores

Buscar un Valor Añadir un Valor

Número máximo de filas para recuperar (hasta 300): 300

Unidad Negocio: =

ID Oper Fnc: Comienza por

Tipo Documento: Comienza por

Plantilla: Comienza por

Fecha Transacción: =

Entd Contratante: Comienza por

Tratamiento Contable: =

Estado Oper Fnc: =

Oper Fnc Mstr: Comienza por

ID Oper Com: Comienza por

ID Valor: Comienza por

Buscar Borrar Búsqueda Básica Guardar Criterios Búsqueda

6A10-005-003



5. Se muestra la pantalla de Detalle de Operación Financiera del DM seleccionado y damos clic en [Venta/Recompra](#)

Detalle Operación Financiera | Instrucciones de Liquidación

UN: IMSSR ID Oper Fnc: DM0000258974 Tipo Documento: M Plantilla:

*Fecha Transacción: 11/04/2022 ID Oper Com: TR0000121082
ID Valor: SEC0002464 Serie: 310529 Emisor: BONOS
ID Plz Crédito: Ag Clasf Crediticia: Valor: [Añad Clasf Crediticia](#)

Detalle Oper Fnc Buscar | Ver Todo | Primero | 1 de 1 | Último

Línea: 1 de 1 Tipo Base Documento: Oper Física Tipo Interés

Detalles Oper Física Tipo Int

*F Liquidación: 13/04/2022 Plazo: 3333 *Fecha Vencimiento: 29/05/2031
Fecha Emisión: 09/12/2021 F Inicio Cupón: 09/12/2021
Clasificación: Inversión *Tipo Ajuste: Fijo
Tipo: 7.75000000 Índ Ajuste:
Operador Márgenes: Margen Índice:
*Base Cálculo Intereses: Real/360 *Cálculo Intereses: Con Intereses
Títulos: 700,000.00 Precio Nominal: 100.00000000
*Valor Nominal: 70,000,000.00 *Moneda: MXN
*Impt Liquidación: 67,031,838.41 *Precio Limpio: 93.06879893
Interés Pedido: 1,883,680.56 Descuento/Prima: Lineal
Rend: 8.88000393 Fecha Vencimiento Estimada:
*Mét Amort: Sin Amortización

Fechas y Cálculo Interés

Cartera: GMP *Tratamiento Contable: IF para cobrar Princ e Inter
Agente: *Entd Contratante: 6025 HSBC
Emisor: GOB Garante: GOB
Clasif. Act.: GUBTFINAC Referencia:

Descripción: 9.1 años a 2031-05-29 inversión MXN 70.0m. @ 7.75%

Estado Oper Fnc: Abierto Autorizado

Excluir de Posición
 Revisión Preliminar
 Compen Fij Caja Liqd Oper Fnc

Flujos Caja | Prueba Limite | Cprb OF | Reserva | Imprimir

[Req Evento](#) [Comis](#) [Notas Documentos](#) [Festivos Adicionales](#) [Ofertas](#) [Secuencia Documentos](#)

[Información Fondo](#) [Análisis Oper Fnc](#) **[Venta/Recompra](#)** [Fechas Interés](#)

[Anexos \(0\)](#)

[Guardar](#) [Volver a Buscar](#) [Notificar](#)

6A10-005-003



6. Aparece la pantalla de **Actz/Visualización de Detalles Venta/Recompra** y capturamos la siguiente información:

- Fecha de Liquidación.
- Títulos a Vender (cantidad ya sea total o parcial)
- Importe Nominal Rever (Valor Nominal)
- Pct Prc Val Nominal (Precio Limpio)
- Entidad Contratante
- Referencia (TR)
- Cuenta Liquidación (Cartera).

Actz/Visualización de Detalles Venta/Recompra

UN:	IMSSR	ID Oper Fnc:	DM0000258974	Tipo Documento:	M	Plantilla:	
Fechas Transacción							
Fecha Reversión:	04/05/2023			Títulos a Vender	700,000		
Fecha Liquidación:	08/05/2023						
Liquidación Reversión							
<input type="radio"/> Pago <input checked="" type="radio"/> Cobro							
Impt Nom Rever:	70,000,000.00	Saldo Principal Reversión:	70,000,000.00				
Moneda Venta:	MXN	% Prorateo Reversión:	100.00000000				
Pct Prc Val Nominal:	94.39028900	Prima/Dto Amortizado:	-567,722.30				
Importe Principal Reversión:	66,073,202.30	Prima/Dto Desamortizado:	-4,284,119.85				
Importe Devengado Reversión:	2,275,486.11	Dto/Pri Desamortizada Cancel:	-4,284,119.85				
Impte Liquidación Reversión:	68,348,688.41	Saldo Comisión:	0.00				
Valor Contable Reversión:	65,715,880.15	Comisión Amortizada:	0.00				
P/G Baja:	357,322.15	Comisión Desamortizada:	0.00				
		Comisión Cancel:	0.00				
Entd Contratante				Instrucciones Liquidación			
ID Set:	IMSS1	ID Set Banco Venta:	IMSS1				
Entd Contratante:	5026	Banco Liquidación:	BBVA1	GRUPO FINANCIERO BBVA BANCOMER			
Opr Fnc:	DM258974	Cuenta Liquidación:	RFAP	RESERVA FINANCIERA Y ACTUARIAL			
Referencia:	TR0000132100	Instrucciones Liquidación:	GNRLF	INSTRUCCION GENERICA IMSS			
		Método Pago:		▼			
		Formato:					
<input type="button" value="Aceptar"/> <input type="button" value="Cancelar"/>							

6A10-005-003



7. Una vez capturados los datos señalados en el punto anterior, validamos que la información que arroja el sistema concuerde con los cálculos realizados en hoja de cálculo "Ventas DDMMAA", los datos a verificar son los siguientes:

Actz/Visualización de Detalles Venta/Recompra

UN: IMSSR ID Oper Fnc: DM0000258974 Tipo Documento: M Plantilla:

Fechas Transacción

Fecha Reversión: 04/05/2023
Fecha Liquidación: 08/05/2023

Titulos a Vender 700,000

Liquidación Reversión

Pago Cobro

Saldo Principal Reversión: 70,000,000.00
% Prorateo Reversión: 100.00000000
Prima/Dto Amortizado: -567,722.30
Prima/Dto Desamortizado: -4,284,119.85
Dto/Pri Desamortizada Cancel: -4,284,119.85
Saldo Comisión: 0.00
Comisión Amortizada: 0.00
Comisión Desamortizada: 0.00
Comisión Cancel: 0.00

Impt Nom Rever: 70,000,000.00
Moneda Venta: MXN
Pct Prc Val Nominal: 94.39028900

Importe Principal Reversión: 66,073,202.30
Importe Devengado Reversión: 2,275,486.11
Impte Liquidación Reversión: 68,348,688.41
Valor Contable Reversión: 65,715,880.15
P/G Baja: 357,322.15

Entd Contratante

ID Set: IMSS1
Entd: 5026
Contratante: DM258974
Referencia: TR0000132100

Instrucciones Liquidación

ID Set Banco Venta: IMSS1
Banco Liquidación: BBVA1 GRUPO FINANCIERO BBVA BANCOMER
Cuenta Liquidación: RFAP RESERVA FINANCIERA Y ACTUARIAL
Instrucciones Liquidación: GNRLR INSTRUCCION GENERICA IMSS
Método Pago:
Formato:

Aceptar Cancelar

- Si la información es correcta damos clic en

Aceptar



8. Nos arroja una pantalla de aviso donde pregunta si estamos seguros de querer registrar la transacción de venta/recompra, si estamos seguros damos clic en

ORACLE

Favoritos Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Aviso: ¿Está seguro de que quiere registrar esta transacción de venta/recompra? (13800,2289) La actividad de venta/recompra impide cambios posteriores en la operación financiera.

9. Posteriormente damos clic en flujos caja,

Cartera: *Tratamiento Contable: IF para cobrar Princ e Intel

Agente: *Entd Contratante: HSBC

Emisor: Garante:

Clasif. Act.: Referencia:

Descripción:

Estado Oper Fnc: Autorizado

Excluir de Posición

Revisión Preliminar

Compen Fij Caja Liqd Oper Fnc

[Req Evento](#) [Comis](#) [Notas Documentos](#) [Festivos Adicionales](#) [Ofertas](#) [Secuencia Documentos](#)

[Información Fondo](#) [Análisis Oper Fnc](#) [Venta/Recompra](#) [Fechas Interés](#)

[Anexos \(0\)](#)

6A10-005-003



10. El sistema nos arroja la pantalla que contiene el importe de la utilidad contable por la venta realizada, mismo que invariablemente deberá coincidir con la utilidad contable determinada en el formato de hoja de cálculo "Ventas DDMMAA", posteriormente damos click en

Volver

ORACLE

Favoritos Menú Principal > Gestión de Oper Financieras > Reg Operaciones Financieras > Operaciones Financieras

Flujos de Caja

Detalles						Personalizar	Buscar	Ver Todo	Primero	1-8 de 8	Último
Fecha Liquidación	Descripción	Impte	Moneda	Fecha Nominal	Fecha Interés						
02/13/2020	Principal	-110,351,745.12	MXN								
06/11/2020	Interés	3,939,583.33	MXN	06/11/2020	06/11/2020						
12/10/2020	Interés	3,918,055.56	MXN	12/10/2020	12/10/2020						
06/10/2021	Interés	3,918,055.56	MXN	06/10/2021	06/10/2021						
12/09/2021	Interés	3,918,055.56	MXN	12/09/2021	12/09/2021						
06/09/2022	Interés	3,918,055.56	MXN	06/09/2022	06/09/2022						
12/08/2022	Interés	3,918,055.56	MXN	12/08/2022	12/08/2022						
05/11/2023	Liquidación Venta	111,879,539.68	MXN								

Volver

6A10-005-003