

Raport o aktywach netto FIZ (WANCI)

Departament Funduszy Inwestycyjnych i Funduszy Emerytalnych

tel. +48 22 262-50-37

dff@knf.gov.pl

Urząd Komisji Nadzoru Finansowego

ul. Piękna 20, 00-549 Warszawa

www.knf.gov.pl

Spis treści

1	Podstawowe informacje o raporcie	2
2	Format pliku CSV	3
2.1	Specyfikacja techniczna pliku TFIWANCI	3
2.2	Reguły walidacyjne pliku TFIWANCI.....	5
3	Opis formularza ESPI.....	7
3.1	Instrukcja dodawania plików do formularza ESPI.....	7
3.2	Dodatkowe wyjaśnienia	9

1 Podstawowe informacje o raporcie

- **Podstawa prawna:**

§ 11 ust. 1 pkt 32) rozporządzenia Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 28 czerwca 2017 r. w sprawie okresowych sprawozdań oraz bieżących informacji dotyczących działalności i sytuacji finansowej towarzystw funduszy inwestycyjnych i funduszy inwestycyjnych dostarczanych przez te podmioty Komisji Nadzoru Finansowego (dalej: Rozporządzenie)

- **Dodatkowe wyjaśnienia i informacje** oraz odpowiedzi na zadane przez podmioty nadzorowane pytania dotyczące raportu TFI-WANCI (Q&A) znajdują się na stronie:

https://www.knf.gov.pl/komunikacja/raportowanie/obowiazki_informacyjne_TFI/Q&A

- **Termin przekazywania** – następny dzień roboczy po dniu wystąpienia zdarzenia lub powzięcia wiadomości o nim przez fundusz.
- **Raport przesyłany jest za pomocą systemu ESPI.** Należy zwrócić uwagę na to aby wysłać raport we właściwej roli (TFI) i na właściwą kancelarię (DFI).
- **Nazwa formularza:**
 - „TFI-WANCI_30.06.20”
- **Dane sprawozdawcze** – plik CSV załączony do formularza „TFI-WANCI_30.06.20” w ustrukturyzowanej formie.

2 Format pliku CSV

2.1 Specyfikacja techniczna pliku TFIWANCI

- Plik CSV z kodowaniem znaków CP-1250 wg układu określonego w poniższej tabeli.
- Pierwszy wiersz pliku CSV powinien zawierać nazwy pól zgodnie z poniższą tabelą (kolumna 2) ze średnikiem jako separatorem pól.
- Separatory:
 - separatorem pól jest średnik przy czym ostatnie pole w rekordzie nie powinno być zakończone średnikiem,
 - końcem linii (rekordu) jest ciąg dwóch znaków o wartościach ASCII równych 13 i 10 (szesnastkowo 0x0D i 0x0A) oznaczający koniec bieżącej linii tekstu tj. CRLF (CR, ang. *carriage return*) + (LF, ang. *line feed*),
 - separatorem dziesiętnym dla liczb zmiennoprzecinkowych jest przecinek,
 - nie należy używać separatora tysięcznego (spacja, kropka, przecinek).
- Nie należy używać cudzysłowów jako kwalifikatorów tekstu, ani na początku ani na końcu rekordu.
- Konwencja nazewnicza:

Plik powinien być nazwany zgodnie z poniższym wzorem:

TFIWANCI_IdKrajowyTFI_RRRRMMDD_000.CSV

gdzie:

- TFIWANCI – określenie rodzaju pliku,
- IdKrajowyTFI – identyfikator krajowy TFI przesyłającego raport WANCI. W przypadku przejęcia zarządzania funduszem przez depozytariusza, identyfikator jest uzgadniany z organem nadzoru,
- RRRRMMDD – oznaczenie dnia wyceny, którego dotyczy dany plik,
- 3-znakowe określenie czy plik jest plikiem podstawowym czy korektą (3 znaki uzupełnione od lewej „0” wiodącym) - dla pliku podstawowego 000, dla pierwszej poprawki 001, dla kolejnej 002 itd.

Przykład:

TFIWANCI_PLTFI000004_20200630_000.CSV - plik podstawowy za dzień wyceny 30.06.2020 przesłany przez Aviva Investors Poland S.A.

TFIWANCI_PLTFI000004_20200630_001.CSV – pierwsza korekta pliku za dzień wyceny 30.06.2020 przesłana przez Aviva Investors Poland S.A.

- Układ pliku CSV:

Nr pola	Nazwa pola / elementu	Opis pola FIZ	Typ danych	Komentarz
1	RowNumber	Nr rekordu w pliku	Number(8)	kolejny numer z sekwencji
2	FundIdentification	Identyfikator krajowy funduszu	Varchar(11)	identyfikator krajowy funduszu / subfunduszu, którego dotyczą raportowane certyfikaty inwestycyjne
3	CurrencyCode	Waluta	Varchar(3)	waluta, w której są emitowane i wykupywane przez fundusz CI danej emisji i/lub serii lub waluta funduszu gdy oznaczenie ALL w polu nr 5 3-znakowy kod waluty zgodny z normą ISO 4217 np. PLN, EUR, USD
4	ValuationDate	Data wyceny (YYYYMMDD)	Date	w formacie YYYYMMDD
5	IssueCode	Emisja	Varchar(15)	oznaczenie ALL lub oznaczenie emisji certyfikatów inwestycyjnych, <i>pole obowiązkowe</i> powinno być stosowane konsekwentnie w kolejnych raportach
6	SerieNumber	Seria	Varchar(15)	oznaczenie serii certyfikatów inwestycyjnych <i>pole opcjonalne</i> - pozostaje niewypełniane w przypadku braku serii lub wartości ALL w polu nr 5 powinno być stosowane konsekwentnie w kolejnych raportach
7	NetAsstValPerUnit	Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny funduszu danej serii*	Number(19,4)	w walucie, wskazanej w polu nr 3 gdy w polu nr 5 wartość ALL, wówczas iloraz wartości z pola nr 9 i 8
8	Unit	Liczba certyfikatów inwestycyjnych danej serii*	Number(19,6)	gdy w polu nr 5 wartość ALL, wówczas suma wszystkich certyfikatów w funduszu / subfunduszu
9	NetAssetValue	Wartość aktywów netto funduszu / subfunduszu	Number(19,2)	w walucie, wskazanej w polu nr 3 pole wypełniane tylko dla wartości ALL w polu nr 5
10	AssetValue	Wartość aktywów funduszu / subfunduszu	Number(19,2)	w walucie, wskazanej w polu nr 3 pole wypełniane tylko dla wartości ALL w polu nr 5

*gdy w emisji nie występują serie, wówczas wartości w polach nr 7 i 8 dotyczą certyfikatów wskazanej emisji

- **Przykłady nagłówka i rekordów w pliku:**

Nagłówek:

RowNumber;FundIdentification;CurrencyCode;ValuationDate;IssueCode;Serie-
Number;NetAsstValPerUnit;Unit;
NetAssetValue;AssetValue

Rekordy w pliku dot. serii:

1;PLFIZ000001;PLN;20200630;ABC;1;1254,14;1000;;

2;PLFIZ000001;PLN;20200630;ABC;2;1500,25;2000;;

Rekord w pliku dla wartości ALL w polu nr 5:

3;PLFIZ000001;PLN;20200630;ALL;;1418,21;3000;4254640;4554640,22

Rekord w pliku dot. emisji gdy nie występują serie:

25;PLFIZ000002;PLN;20200630;XYZ;;1554,14;2000;;

2.2 Reguły walidacyjne pliku TFIWNCI

Lp.	Kod błędu	Opis błędu	Obowiązuje od:
1	WNC001	Pierwsze znaki identyfikatora krajowego raportowanego (sub)funduszu inne niż 'PLFIZ'	01.07.2020
2	WNC002	Identyfikator krajowy nie składa się z 11 znaków	01.07.2020
3	WNC003	Identyfikator krajowy nie ma rekordu z polem IssueCode = 'ALL' oraz SerieNumber = 'NULL'	01.07.2020
4	WNC004	Identyfikator krajowy ma więcej niż jeden rekord z polem IssueCode = 'ALL' oraz SerieNumber = 'NULL'	01.07.2020
5	WNC005	IssueCode = 'ALL' i brak wartości w kolumnie NetAssetValue lub AssetValue	01.07.2020
6	WNC006	IssueCode inny niż 'ALL' i występują wartości w NetAssetValue lub AssetValue	01.07.2020
7	WNC007	Nazwa pliku niezgodna z wymaganym szablonem	01.07.2020
8	WNC008	Format daty ValuationDate inny niż 'YYYYMMDD'	01.07.2020
9	WNC009	NetAsstValPerUnit, gdy pole IssueCode = 'ALL' nie równa się ilorazowi wartości z pól NetAssetValue i Unit	01.07.2020
10	WNC010	Identyfikator krajowy ma więcej niż jeden rekord z takimi samymi wartościami w polach IssueCode i SerieNumber	01.07.2020
11	WNC011	Nieprawidłowy numer korekty (brak pliku z numerem korekty niższym o 1 od przesłanego pliku)	01.07.2020
12	WNC012	Wartość AssetValue jest niższa niż wartość NetAssetValue	01.07.2020
13	WNC013	Pole IssueCode jest NULL	01.07.2020
14	WNC014	Dla danego identyfikatora krajowego waluta wskazana w polu CurrencyCode w rekordzie, gdy IssueCode = 'ALL' nie występuje w żadnym rekordzie, gdy IssueCode inne niż 'ALL'	01.07.2020

Lp.	Kod błędu	Opis błędu	Obowiązuje od:
15	WNC015	Wartość WAN funduszu na dany dzień wyceny jest większa od 0, a WANCI jest równe 0, dla jakiegokolwiek kategorii serii lub emisji	01.07.2020
16	WNC016	Data wyceny w nazwie i w treści pliku nie jest identyczna	01.07.2020
17	WNC017	W pliku są rekordy zawierające różne daty wyceny dla różnych funduszy	01.07.2020
18	WNC018	Dla identyfikatora krajowego nie ma rekordu z wartością IssueCode = 'ALL' i co najmniej jednego rekordu z wartością IssueCode inną niż 'ALL'	01.07.2020
19	WNC019	Pole CurrencyCode nie jest wypełnione	01.07.2020
20	WNC020	Błąd, gdy numer wiersza w polu RowNumber nie odpowiada sekwencji n+1 lub jest niewypełniony	26.10.2020

3 Opis formularza ESPI

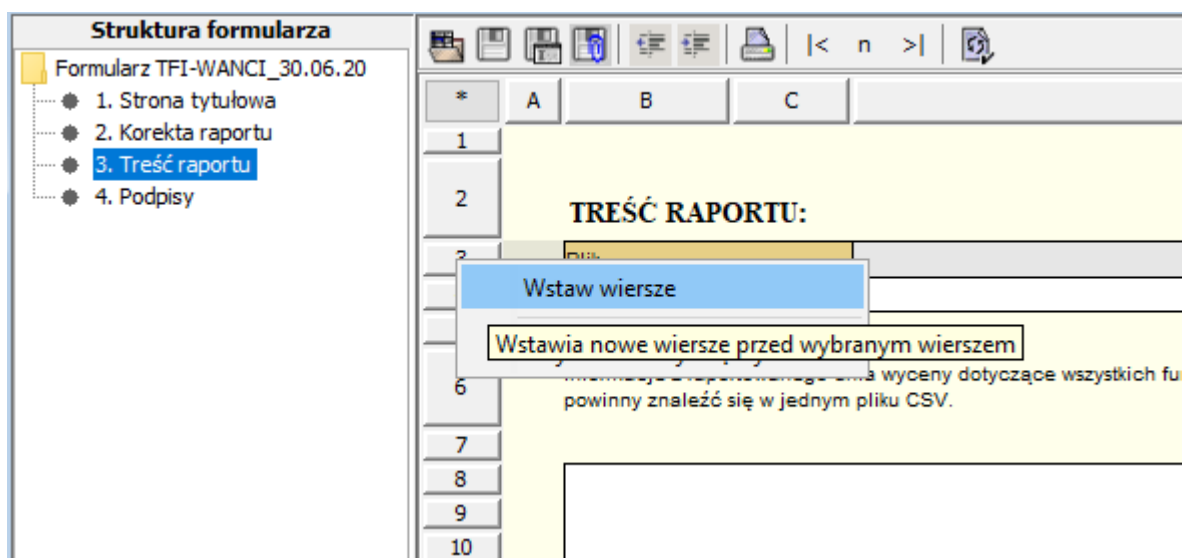
3.1 Instrukcja dodawania plików do formularza ESPI

Zaleca się by wszystkie raportowane danego dnia pliki przysyłać za pomocą jednego formularza ESPI korzystając z funkcjonalności polegającej na wstawianiu dowolnej liczby wierszy z polem, do którego można załączać plik.

- **Sposób postępowania w takim przypadku opisuje następująca instrukcja:**

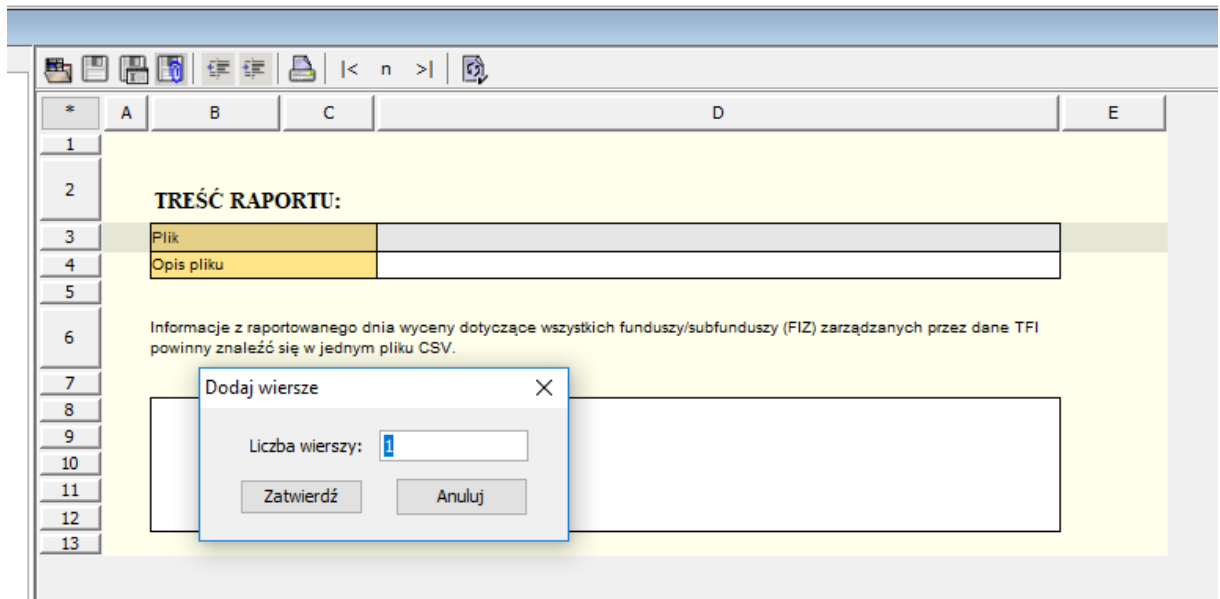
Krok 1. Uruchomienie opcji „Wstaw wiersze”

W celu dodania dodatkowych pól do załączania kolejnych plików należy ustawić kursor na linii siatki (szary, wypukły obszar zawierający numerację wierszy) na poziomie wiersza numer „3”. Pojedynczym kliknięciem prawym przyciskiem myszy należy otworzyć menu podręczne i wybrać polecenie „Wstaw wiersze”.



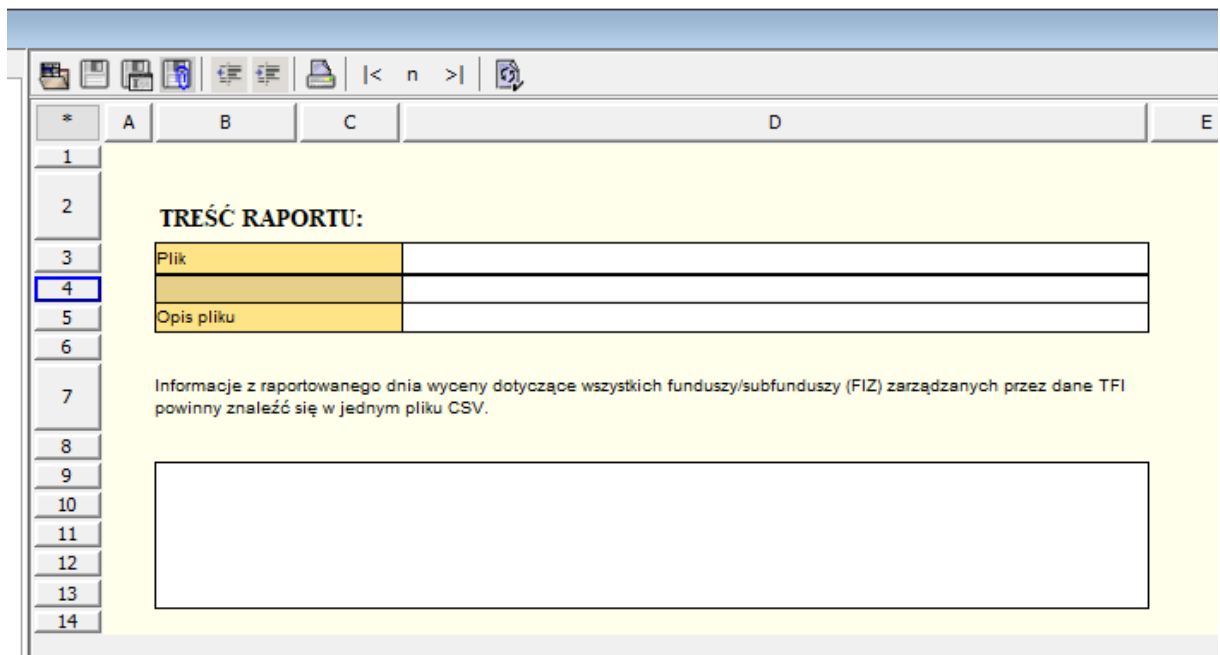
Krok 2. Określenie liczby wierszy do dodania

Pojawi się wówczas okno, które umożliwi wprowadzenie liczby potrzebnych wierszy. Po wprowadzeniu odpowiedniej wartości, wybór liczby wierszy należy zatwierdzić poprzez i pojedyncze kliknięcie lewym klawiszem myszy przycisku „Zatwierdź”.



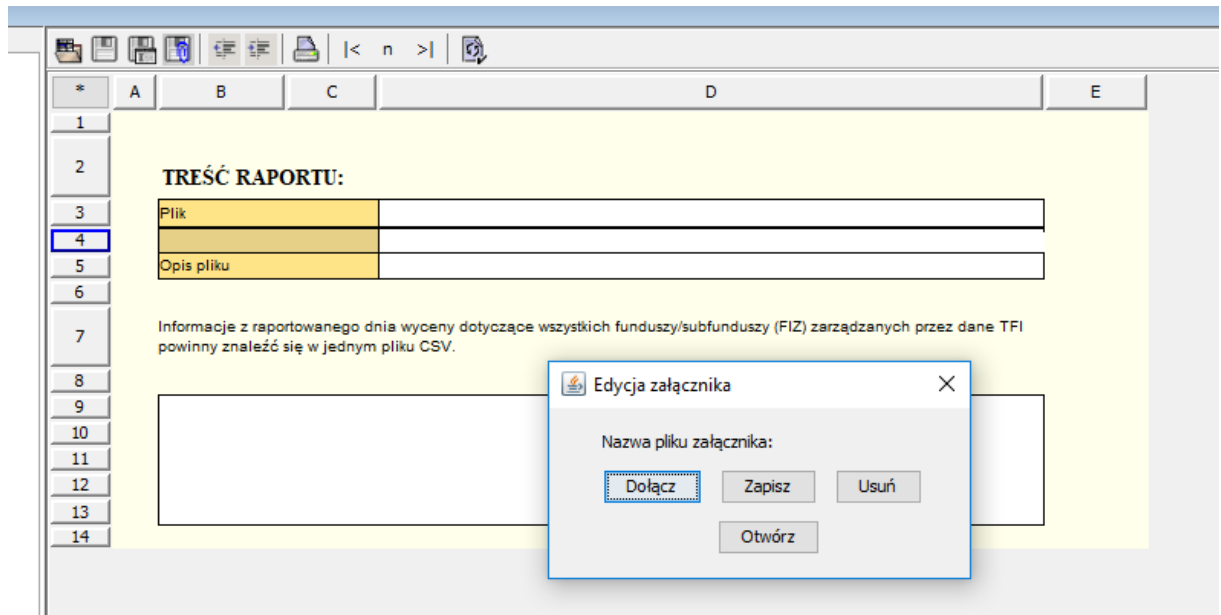
Krok 3. Zakończenie rozbudowy pól w formularzu/Widok końcowy

Po dokonaniu zatwierdzenia na formularzu pojawi się oczekiwana liczba wierszy.



Krok 4. Załączanie pliku do komórki we wstawionym wierszu

Pojedynczym kliknięciem lewym przyciskiem myszy na komórkę D4 we wstawionym wierszu pojawi się okno pozwalające na załączenie kolejnego pliku do formularza ESPI.



3.2 Dodatkowe wyjaśnienia

- Ze względu na przyjęty sposób raportowania zgodnie, z którym dane sprawozdawcze są zawarte w plikach załączanych do formularza ESPI, każdy formularz „TFI-WANCI_30.06.20” powinien otrzymywać kolejny numer raportu.