

Raport o wykupach FIZ (WCI)

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 TFIWCI	3
2.2	Reguły walidacyjne pliku TFIWCI	6
3	Opis formularza ESPI.....	8
3.1	Instrukcja dodawania plików do formularza ESPI.....	8
3.2	Dodatkowe wyjaśnienia	10

1 Podstawowe informacje o raporcie

- **Podstawa prawna:**

§ 11 ust. 1 pkt 10) 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)

art. 225 ust. 2 ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz. U. z 2016 r. poz. 1896, z późn. zm., dalej Ustawa)

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

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

- **Termin przekazywania** – termin przekazywania plików jest uzależniony od rodzaju zdarzenia raportowanego w pliku:

- w przypadku, gdy zostały zrealizowane żądania wykupu lub nastąpił wykup automatyczny (nawet nie w pełnej wysokości) przesłanie raportu WCI jest realizacją obowiązku informacyjnego określonego w § 11 ust. 1 pkt 10 Rozporządzenia, z terminem dostarczenia do Komisji **następnego dnia roboczego po wystąpieniu zdarzenia (zakończenie wykupu),**

- w przypadku wykupienia certyfikatów inwestycyjnych przez FIZ, który podlega obowiązkom informacyjnym wynikającym z przepisów wydanych na podstawie art. 60 ust. 2 ustawy o ofercie publicznej i warunkach wprowadzania instrumentów finansowych do zorganizowanego systemu obrotu oraz o spółkach publicznych, **następnego dnia roboczego po wystąpieniu zdarzenia (zakończenie wykupu),** którego dotyczy raport,

- w przypadku niezrealizowanych żądań wykupu lub niezrealizowanym wykupie automatycznym (również w sytuacji 100% redukcji dopuszczalnej statutu) przez wszystkie **FIZ w terminie 10 dni po dniu wykupu.**

- **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-WCI_01.04.2021”

- **Dane sprawozdawcze** – plik CSV/paczka plików CSV załączony do formularza „TFI-WCI_01.04.2021” w ustrukturyzowanej formie.

2 Format pliku CSV

2.1 Specyfikacja techniczna pliku TFIWCI

- 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:

TFIWCI_IdKrajowyTFI_KodPodmiotuPrzygotowującegoPlik_RRRRMMDD_000.CSV

gdzie:

- TFIWCI – określenie rodzaju pliku,
- IdKrajowyTFI – identyfikator krajowy TFI przesyłającego raport WCI. W przypadku przejęcia zarządzania funduszem przez depozytariusza, kod TFI zarządzającego funduszem przed przejęciem,
- KodPodmiotuPrzygotowującegoPlik – w przypadku przygotowywania pliku samodzielnie identyfikator krajowy TFI przygotowującego raport WCI. W przypadku przygotowywania pliku przez podmiot zewnętrzny kodem podmiotu jest numer KRS. Dopuszczalne jest przesłanie przez TFI kilku plików za dany dzień wykupu, o ile każdy plik jest przygotowywany przez inny podmiot zewnętrzny,
- RRRRMMDD – oznaczenie dnia wykupu, 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:

TFIWCI_PLTFI000022_PLTFI000022_20210331_000.csv - plik podstawowy za dzień wykupu 31.03.2021 przesłany przez Noble Funds TFI S.A. i przygotowany przez Noble Funds TFI S.A.

TFIWCI_PLTFI000013_0000123456_20210331_000.csv - plik podstawowy za dzień wykupu 31.03.2021 przesłany przez TFI Allianz Polska S.A. i przygotowany przez podmiot zewnętrzny o nr KRS 0000123456

TFIWCI_PLTFI000022_PLTFI000022_20210331_001.csv – pierwsza korekta za dzień wykupu 31.03.2021 przesłany przez Noble Funds TFI S.A. i przygotowany przez Noble Funds TFI S.A.

TFIWCI_PLTFI000013_0000123456_20210331_001.csv – pierwsza korekta za dzień wykupu 31.03.2021 przesłany przez TFI Allianz Polska S.A. i przygotowany przez podmiot zewnętrzny o nr KRS 0000123456

• **Układ pliku CSV:**

Nr pola	Nazwa pola / elementu	Opis pola FIZ	Wymagalność*	Typ danych	Komentarz
1	RowNumber	Nr rekordu w pliku	M	Number(8)	kolejny numer z sekwencji
2	FundIdentification	Identyfikator krajowy funduszu	M	Varchar(11)	identyfikator krajowy funduszu / subfunduszu nadawany przez organ nadzoru, którego dotyczą raportowane certyfikaty inwestycyjne
3	RedemptionDate	Statutowa data wykupu	M	Date	Statutowa data wykupu w formacie YYYYMMDD
4	EndDate	Data zakończenia wykupywania CI	O	Date	Data zakończenia wykupywania certyfikatów inwestycyjnych w formacie YYYYMMDD Pole wypełniane tylko w przypadku kiedy wykup nastąpił
5	IssueCode	Emisja	M	Varchar(15)	oznaczenie emisji certyfikatów inwestycyjnych powinno być stosowane konsekwentnie w kolejnych raportach i zgodnie z raportem WANCI
6	SerieNumber	Seria	M	Varchar(15)	oznaczenie serii certyfikatów inwestycyjnych powinno być stosowane konsekwentnie w kolejnych raportach i zgodnie z raportem WANCI
7	RedemptionDetails	Rodzaj wykupu	M	Varchar(1)	Rodzaj wykupu (1 / 2 / 3 / 4 / 5 / 6) gdzie rodzaj wykupu: 1. Na żądanie uczestnika z możliwością proporcjonalnej redukcji 2. Na żądanie uczestnika bez możliwości proporcjonalnej redukcji 3. Automatyczny, zależny od wysokości środków płynnych 4. Automatyczny niezależny od wysokości środków płynnych 5. Fakultatywny, zależny od decyzji organów funduszu 6. Inny

Nr pola	Nazwa pola / elementu	Opis pola FIZ	Wymagalność*	Typ danych	Komentarz
8	CurrencyCode	Waluta	M	Varchar(3)	waluta, w której denominowane są certyfikaty inwestycyjne funduszu danej emisji i/lub serii 3-znakowy kod waluty zgodny z normą ISO 4217 np. PLN, EUR, USD
9	NetAsstValPerUnit	Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	M	Number(19,2)	Wartość w walucie, wskazanej w polu nr 8 Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny danej serii, po której dokonywany jest wykup Gdy nie było wykupu a jedynie żądanie wykupu i brak jest bieżącej wyceny należy podać ostatnią dostępną wartość CI
10	ValuationDate	Data wyceny dla wartości wskazanej w polu nr 9 jeśli jest ona na inną datę niż wskazana w polu nr 3	O	Date	W formacie (YYYYMMDD) Pole wypełniane tylko gdy nie została dokonana wycena na dzień wykupu wskazany w polu nr 3
11	RedemptionRequestUnits	Liczba certyfikatów objętych żądaniem wykupu / wykupem automatycznym	M	Number(19)	Liczba certyfikatów inwestycyjnych objętych żądaniem na dany dzień wykupu lub podlegających automatycznemu wykupowi
12	RedeemedUnits	Liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych danej serii	O	Number(19)	Pole wypełniane w przypadku zrealizowanego wykupu
13	OutstandingUnits	Liczba certyfikatów inwestycyjnych danej serii	M	Number(19)	Liczba certyfikatów inwestycyjnych pozostała po zakończeniu wykupywania certyfikatów inwestycyjnych

*M – mandatory (pole obowiązkowe), O – optional (wymagane w określonych przypadkach)

- Przykłady nagłówka i rekordów w pliku:**

Nagłówek:

RowNumber;FundIdentification;RedemptionDate;EndDate;IssueCode;
SerieNumber;RedemptionDetails;CurrencyCode;NetAsstValPerUnit;
ValuationDate;RedemptionRequestUnits;RedeemedUnits;OutstandingUnits

Rekordy dotyczące wykupu:

1;PLFIZ001234;20210331;20210403;A;A;1;PLN;100,15;;50;40;460
2;PLFIZ001234;20210331;20210403;B;B;3;PLN;1000,21;;10;10;200

Rekordy dotyczące żądań wykupu (niezrealizowanych wykupów):

3;PLFIZ012345;20210331;;C;C;1;PLN;50,85;20190331;25000;;50000
4;PLFIZ012345;20210331;;AA;AA;1;PLN;120,95;;1200;;4000

2.2 Reguły walidacyjne pliku TFIWCI

Lp.	Kod błędu	Opis błędu	Obowiązuje od:
1	WCI001	Pierwsze znaki identyfikatora krajowego raportowanego (sub)funduszu inne niż 'PLFIZ'	2020-04-01
2	WCI002	Identyfikator krajowy nie został wypełniony lub nie składa się z 11 znaków	2020-04-01
3	WCI003	Nazwa pliku niezgodna z wymaganym szablonem	2020-04-01
4	WCI004	Nieprawidłowy numer korekty (brak pliku z numerem korekty niższym o 1 od przesłanego pliku)	2020-04-01
5	WCI005	Format daty RedemptionDate inny niż 'YYYYMMDD' lub pole jest niewypełnione	2020-04-01
6	WCI006	Format daty EndDate inny niż 'YYYYMMDD' o ile pole jest wypełnione	2020-04-01
7	WCI007	Format daty ValuationDate inny niż 'YYYYMMDD' o ile pole jest wypełnione	2020-04-01
8	WCI008	Data wykupu w nazwie i w treści pliku nie jest identyczna	2020-04-01
9	WCI009	Data wykupu i data zakończenia wykupowania są identyczne (RedemptionDate = EndDate)	2020-04-01
10	WCI010	Data wykupu późniejsza niż data zakończenia wykupowania (RedemptionDate > EndDate)	2020-04-01
11	WCI011	W pliku są rekordy zawierające różne daty wykupu dla różnych funduszy	2020-04-01
12	WCI012	Numer wiersza w polu RowNumber nie odpowiada sekwencji n+1 lub jest niewypełniony	2020-04-01
13	WCI013	Pole IssueCode nie zostało wypełnione	2020-04-01
14	WCI014	Pole SerieNumber nie zostało wypełnione	2020-04-01
15	WCI015	Pole CurrencyCode nie zostało wypełnione	2020-04-01
16	WCI016	Pole NetAsstValPerUnit nie zostało wypełnione	2020-04-01
17	WCI017	Pole RedemptionDetails nie zostało wypełnione	2020-04-01
18	WCI018	Pole RedemptionRequestUnits nie zostało wypełnione	2020-04-01
19	WCI019	Pole OutstandingUnits nie zostało wypełnione	2020-04-01
20	WCI020	Wartość z pola RedeemedUnits większa niż wartość z pola RedemptionRequestUnits	2020-04-01
21	WCI021	Pole IssueCode wypełnione jako 'ALL'	2020-04-01
22	WCI022	Pole SerieNumber wypełnione jako 'ALL'	2020-04-01
23	WCI023	Identyfikator krajowy ma więcej niż jeden rekord z takimi samymi wartościami w polach IssueCode i SerieNumber	2020-04-01
24	WCI024	Pole RedemptionDetails nie zawiera wartości ze zbioru: {1,2,3,4,5,6}	2020-04-01
25	WCI025	Wartość z pola RedeemedUnits nie jest równa wartości z pola RedemptionRequestUnits, gdy w polu RedemptionDetails zaraportowano wartości {3,4}	2020-04-01
26	WCI026	Pole RedemptionRequestUnits = 0	2020-04-01
27	WCI027	Pole ValutaionDate jest wypełnione, gdy RedeemedUnits jest większe od 0	2020-04-01
28	WCI028	W przypadku gdy pole ValuationDate jest wypełnione RedemptionDate = ValuationDate	2020-04-01

Lp.	Kod błędu	Opis błędu	Obowiązuje od:
29	WCI029	W przypadku gdy pole EndDate jest wypełnione RedeemedUnits jest puste	2020-04-16
30	WCI030	Pole RedeemedUnits = 0	2020-04-16
31	WCISV001	Oznaczenie wykupowanej emisji/serii (pola IssueCode oraz SerieNumber) nie występuje dla danego funduszu w pliku WANCI na dany dzień wyceny	2020-04-01
32	WCISV002	NetAsstValPerUnit, po którym dokonywany jest wykup emisji/serii danego funduszu jest niezgodny z NetAsstValPerUnit z pliku WANCI na dany dzień wyceny	2020-04-01
33	WCISV003	RedemptionRequestUnits dotyczący wykupu emisji/serii danego funduszu zawiera większą wartość niż zaraportowana w polu Unit z pliku WANCI na dany dzień wyceny	2020-04-01
34	WCISV004	OutstandingUnits pozostałe po zakończeniu wykupywania CI dotyczące wykupu emisji/serii danego funduszu nie równają się różnicy pól: Unit z pliku WANCI na dany dzień wyceny i RedeemedUnits	2020-04-01
35	WCISV005	W pliku korygującym data w polu EndDate nie jest równa dacie raportowanej w polu EndDate w pliku korygowanym dla powtarzanych rekordów	2020-04-01

3 Opis formularza ESPI

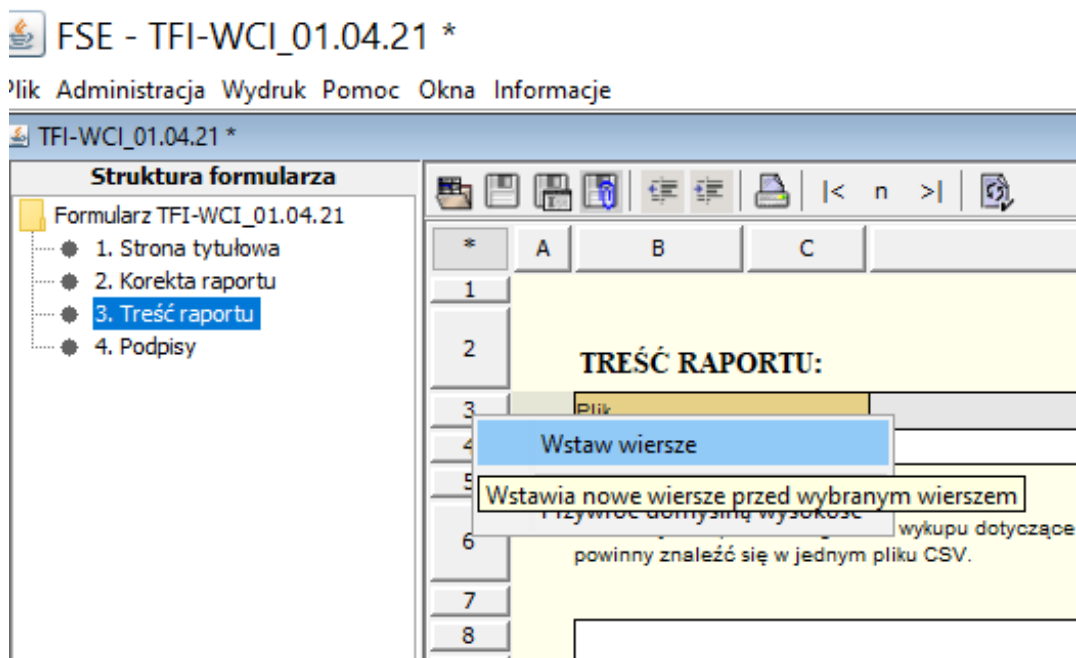
3.1 Instrukcja dodawania plików do formularza ESPI

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:**

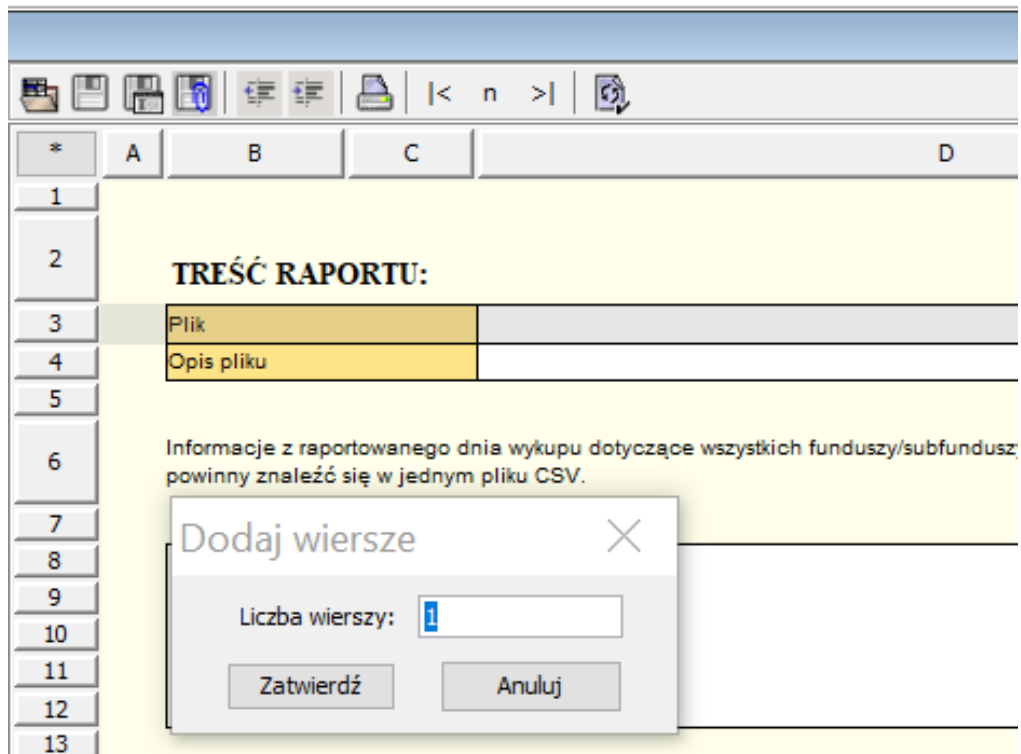
Krok 1. Uruchomienie opcji „Wstaw wiersze”

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”.



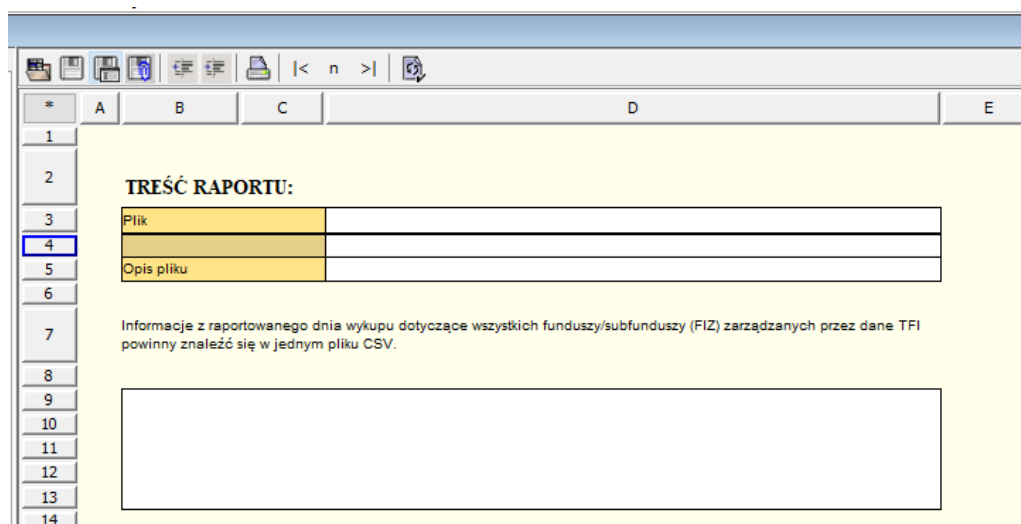
Krok 2. Określenie liczby wierszy do dodania

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”.



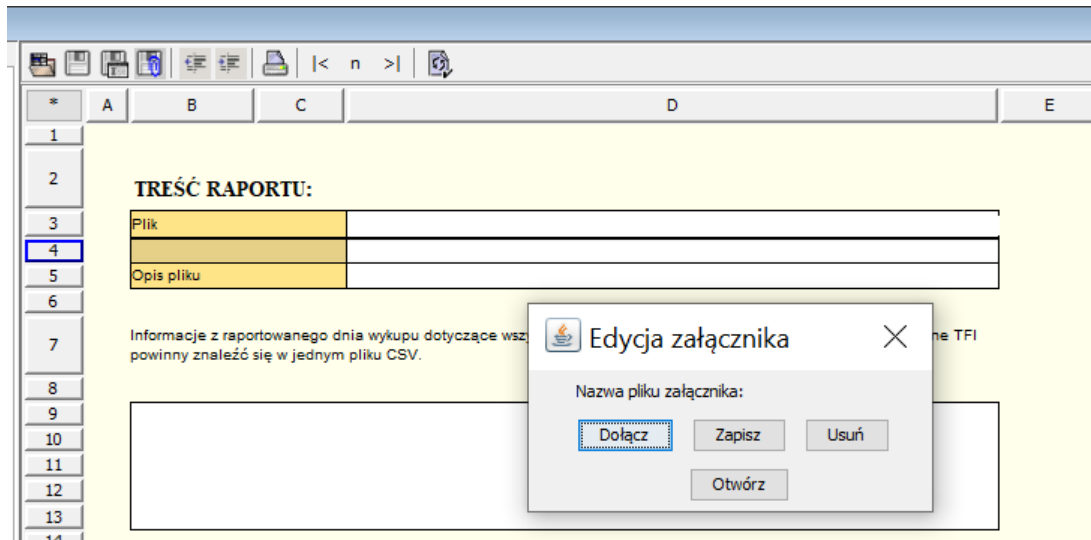
Krok 3. Zakończenie rozbudowy pól w formularzu/Widok końcowy

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 D3 lub 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-WCI_01.04.21” powinien otrzymywać kolejny numer raportu.