

Raport o aktywach netto (WANJU)

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 TFIWANJU.....	3
2.2	Reguły walidacyjne pliku TFIWANJU	6
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:**

§ 18 ust. 1 pkt 4 rozporządzenia ws. okresowych sprawozdań oraz bieżących informacji dotyczących działalności i sytuacji finansowej towarzystw funduszy inwestycyjnych i funduszy inwestycyjnych dostarczanych przez te podmioty Komisji Nadzoru Finansowego

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

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

- **Termin przekazywania** – 4 dni robocze po zakończeniu miesiąca, którego dotyczy raport.
- **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-WANJU_30.06.17”
- **Dane sprawozdawcze** – plik CSV załączony do formularza „TFI-WANCI_30.06.20” w ustrukturyzowanej formie.

2 Format pliku CSV

2.1 Specyfikacja techniczna pliku TFIWANJU

- 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:

TFIWANJU_IdKrajowyTFI_RRRRMMDD_000.CSV

gdzie:

- TFIWANJU – określenie rodzaju pliku,
- IdKrajowyTFI – identyfikator krajowy TFI przesyłającego raport WANJU,
- 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:

TFIWANJU_PLTFI000004_201912_000.CSV - plik podstawowy za grudzień 2019 roku przesłany przez Aviva Investors Poland S.A.

TFIWANJU_PLTFI000004_201912_001.CSV – pierwsza korekta pliku za grudzień 2019 roku przesłana przez Aviva Investors Poland S.A.

- Układ pliku CSV:

Nr pola	Nazwa pola	Opis pola	Typ danych	Komentarz
1	RowNumber	Nr rekordu w pliku	Number(8)	kolejny numer z sekwencji
2	FundIdentification	Identyfikator krajowy funduszu / subfunduszu	Varchar(11)	Identyfikator krajowy funduszu / subfunduszu, który zbywa raportowane kategorii JU. W przypadku subfunduszu powinien to być identyfikator krajowy subfunduszu, a nie funduszu parasolowego.
3	FundName	Nazwa funduszu / subfunduszu	Varchar(250)	Nazwa funduszu / subfunduszu, który zbywa raportowane kategorii JU. W przypadku subfunduszu powinna to być nazwa subfunduszu, a nie funduszu parasolowego.
4	CurrencyCode	Waluta	Varchar(3)	Waluta, w której są zbywane i odkupywane przez fundusz JU danej kategorii 3-znakowy kod waluty zgodny z normą ISO 4217 np. PLN, EUR, USD
5	ValuationDate	Data wyceny (YYYYMMDD)	Date	Należy przysyłać dane, tylko za dni wyceny
6	UnitType	Kategoria jednostki uczestnictwa funduszu	Varchar(15)	kategoria JU zgodna ze statutem funduszu
7	PrimaryUnitFlag	Flaga kategorii podstawowej	Number(1)	1 – dla podstawowej kategorii JU 0 – pozostałe kategorie JU Jeżeli JU kategorii podstawowej mogą być zbywane w różnych walutach, wówczas flagą należy oznakować JU wyrażone w PLN.
8	NetAssetValuePerUnit	Wartość aktywów netto na jednostkę uczestnictwa funduszu danej kategorii	Number(19,4)	w walucie, wskazanej w polu nr 4
9	AssetValue	Wartość aktywów ogółem funduszu / subfunduszu (w zł)	Number(19,2)	Pole wypełniane w rekordach oznaczonych wartością 1 w polu PrimaryUnitFlag W pozostałych rekordach należy pozostawić niewypełnione.
10	NetAssetValue	Wartość aktywów netto ogółem funduszu / subfunduszu (w zł)	Number(19,2)	Pole wypełniane w rekordach oznaczonych wartością 1 w polu PrimaryUnitFlag W pozostałych rekordach należy pozostawić niewypełnione.
11	CapitalChange	Saldo kapitału ogółem funduszu / subfunduszu w miesiącu, którego dotyczy sprawozdanie (w zł)	Number(19,2)	Pole wypełniane w rekordach oznaczonych wartością 1 w polu PrimaryUnitFlag dla ostatniego dnia wyceny w danym miesiącu. W pozostałych rekordach należy pozostawić niewypełnione. Zmiana kapitału dla funduszu / subfunduszu w miesiącu, w przypadku braku zdarzeń zbycia lub

Nr pola	Nazwa pola	Opis pola	Typ danych	Komentarz
				odkupienia jednostek uczestnictwa w raportowanym okresie, wartość ta powinna co do zasady wynosić 0 zł.

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

- **Nagłówek:**

RowNumber;FundIdentification;FundName;Currency;ValuationDate;UnitType;PrimaryUnitFlag;NetAssetValuePerUnit;AssetValue;NetAssetValue;CapitalChange

- **Pierwszy rekord w pliku z PrimaryUnitFlag (flagą kategorii podstawowej) równą 1:**

1;PLFIO000200;Nazwa funduszu;PLN;2019-12-02;A;1;12,53;123456,78;123178,1;

- **Rekord w pliku z daną w polu CapitalChange:**

20;PLFIO000200;Nazwa funduszu;PLN;2019-12-31;A;1;12,98;132896,21;129789,33;1542,3

- **Rekord w pliku z PrimaryUnitFlag (flagą kategorii podstawowej) równą 0:**

24;PLFIO000200;Nazwa funduszu;PLN;2019-12-05;B;0;12,12;;;;

2.2 Reguły walidacyjne pliku TFIWANJU

Lp.	Kod błędu	Opis błędu	Obowiązuje od:
1	WJ1001	Pierwsze znaki identyfikatora krajowego raportowanego (sub)funduszu 'PLFIZ'	2020-03-30
2	WJ1002	Identyfikator krajowy nie ma wymaganej długości 11 znaków	2020-03-30
3	WJ1003	Identyfikator krajowy nie ma kategorii jednostek z flagą PrimaryUnitFlag = 1 w danym dniu wyceny	2020-03-30
4	WJ1004	Na dany dzień wyceny identyfikator krajowy ma PrimaryUnitFlag = 1 dla więcej niż jednej kategorii jednostek	2020-03-30
5	WJ1005	PrimaryUnitFlag = 1 i brak wartości w kolumnie NetAssetValue lub AssetValue	2020-03-30
6	WJ1006	PrimaryUnitFlag = 0 i występują wartości w NetAssetValue lub AssetValue	2020-03-30
7	WJ1007	Nazwa pliku niezgodna z wymaganym szablonem	2020-03-30
8	WJ1008	Format daty ValuationDateTime inny niż 'YYYY-MM-DD'	2020-03-30
9	WJ1009	Na ostatni dzień wyceny CapitalChange dla PrimaryUnitFlag = 1 jest niewypełniony	2020-03-30
10	WJ1010	Na inny niż ostatni dzień wyceny CapitalChange jest wypełniony	2020-03-30
11	WJ1011	Nieprawidłowy numer korekty (brak pliku z numerem korekty niższym o 1 od przesłanego pliku)	2020-03-30
12	WJ1012	Wartość AssetValue jest niższa niż wartość NetAssetValue	2020-04-06
13	WJ1013	Pole PrimaryUnitFlag ma wartość inną niż 1 lub 0	2020-04-09
14	WJ1014	Na dany dzień wyceny występuje więcej niż jeden fundusz z tym samym identyfikatorem krajowym oraz flagą PRIMARYUNITFLAG=1	2020-04-28
15	WJ1015	Wartość WAN funduszu na dany dzień wyceny jest większa od 0, a WANJU jest równe 0, dla jakiegokolwiek kategorii jednostek	2020-05-05
16	WJ1016	Pole CurrencyCode nie jest wypełnione	2020-06-09
17	WJ1017	Data wyceny w treści pliku niezgodna z okresem raportowym z nazwy pliku	2020-10-07

3 Opis formularza ESPI

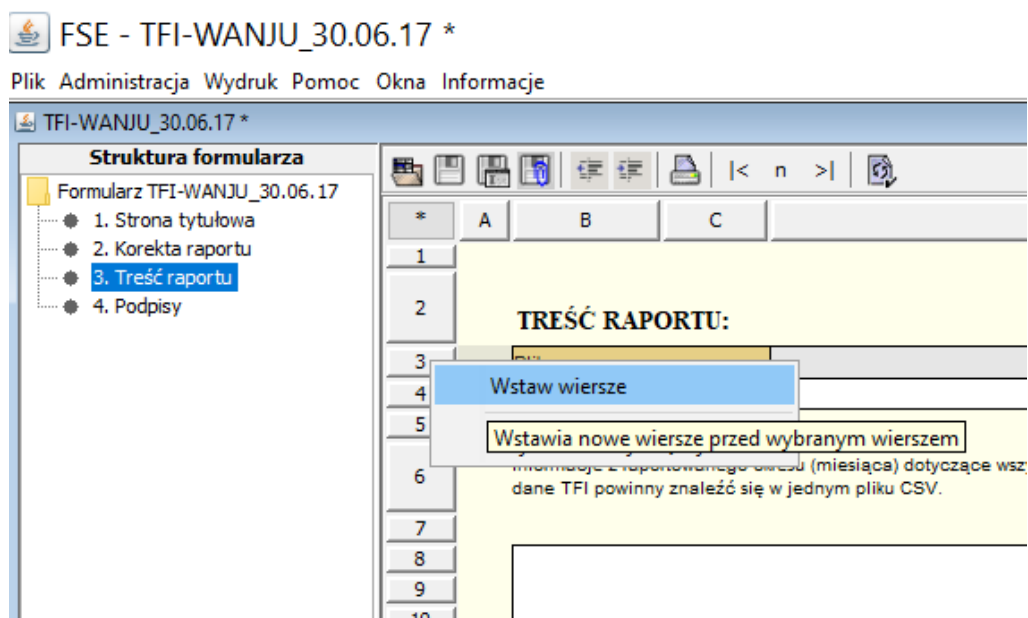
3.1 Instrukcja dodawania plików do formularza ESPI

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”.

TREŚĆ RAPORTU:

Plik	
Opis pliku	

Informacje z raportowanego okresu (miesiąca) dotyczące wszystkich funduszy/subfunduszy (FIO / SFIO) zarządzanych przez dane TFI powinny znaleźć się w jednym pliku CSV.

Dodaj wiersze

Liczba wierszy:

Zatwierdź Anuluj

Krok 3. Zakończenie rozbudowy pól w formularzu/Widok końcowy

Po dokonaniu zatwierdzenia na formularzu pojawi się oczekiwana liczba wierszy.

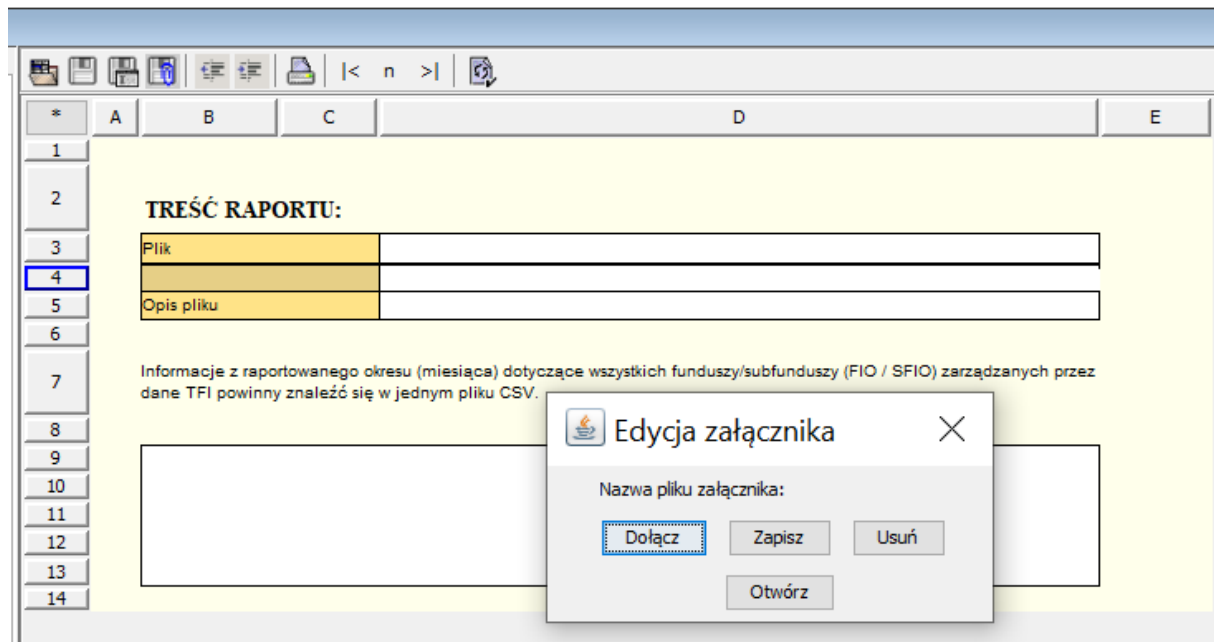
TREŚĆ RAPORTU:

Plik	
Opis pliku	

Informacje z raportowanego okresu (miesiąca) dotyczące wszystkich funduszy/subfunduszy (FIO / SFIO) zarządzanych przez dane TFI powinny znaleźć się w jednym pliku CSV.

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-WANJU_30.06.17” powinien otrzymywać kolejny numer raportu.