



FICHEROS DE DATOS INDIVIDUALES DE IIC. DOCUMENTO EXPLICATIVO DE FONDDERI.

DEPARTAMENTO DE ESTUDIOS, ESTADÍSTICAS Y PUBLICACIONES

23 de abril de 2013

1. ADVERTENCIA

LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE FICHERO PROCEDE DE LAS COMUNICACIONES REALIZADAS A LA CNMV POR LAS IIC O LAS ENTIDADES QUE LA REPRESENTEN, SIENDO ELLAS LAS RESPONSABLES DE SU CALIDAD.

Las comunicaciones posteriores a la generación de este fichero no podrán ser incluidas ni habrá ediciones posteriores, salvo en casos excepcionales en que se haría pública la existencia de esa nueva edición.

Se alerta de que tanto los datos que se incluyen en este fichero como los posibles agregados que el usuario pueda hacer de los mismos, pueden presentar discrepancias respecto a datos aparentemente similares que aparezcan en las estadísticas o en informes publicados por la CNMV, ya que estos últimos además de tener en cuenta las mencionadas comunicaciones posteriores, que se hayan podido producir, pueden haber sido objeto de depuraciones en el tratamiento de los datos.

2. CONTENIDO DEL FICHERO FONDDERI

En la adquisición de FONDDERI, además de este documento explicativo, se reciben dos ficheros: un esquema (.XSD) y un fichero con los datos (.XML).

La información contenida se presenta en 10 campos de los que 4 son identificativos de la IIC o del periodo de referencia. Los campos identificativos sirven para vincularse con FONDREGISTRO¹ que contiene un amplio número de campos descriptivos y clasificatorios de la IIC.

Su periodicidad es trimestral.

Suministra información sobre la cartera de derivados de cada uno de los fondos vivos al cierre de trimestre.

Se especifica: el número de contratos, la fecha de vencimiento, el valor de mercado de dichos contratos y el importe nominal comprometido de cada uno de los derivados de la cartera de derivados del Fondo.

El contenido de la información, referida a fin de trimestre, se centra en las posiciones abiertas de cada uno de los activos financieros que componen la cartera de derivados todos los fondos vivos de forma individualizada.

¹ Se suministra gratuitamente al adquirir uno o más de siguientes ficheros: FONDMENTS, FONDTRIM, FONDPATRIMDISVAR, FONDCART y FONDDERI.

De cada uno de tales activos financieros se dan datos identificativos, características e importe nominal comprometido

La información se facilita a nivel Compartimento o Fondo según sea el caso. No consta el ISIN del compartimento ni el del Fondo pero sí el número de registro del Fondo y/o del compartimento

El universo sobre el que se informa está formado por todos los FI.

Campos del fichero

FechaDatos: Fecha de referencia de los demás campos. Es la de fin de trimestre.

Tipo: Tipo de IIC.

NumeroRegistro: Número de registro del fondo de inversión

CodigoDivisaIIC: Divisa de denominación del compartimento o del fondo según sea el caso.

NumeroCompartimento: Número de registro del compartimento

Descripcion: Se indica por una parte si comporta derecho u obligación y por otra a que tipo de subyacente se refiere, clasificado éste en cuatro modalidades: renta fija, renta variable, tipo de cambio y otros subyacentes.

Por tanto pueden darse las siguientes opciones:

- Derechos en renta fija
- Derechos en renta variable
- Derechos en tipo de cambio
- Otros derechos
- Obligaciones en renta fija
- Obligaciones en renta variable
- Obligaciones en tipo de cambio
- Otras obligaciones

Subyacente: Es un campo texto no normalizado que muestra información sobre el activo subyacente.

Instrumento: Es un campo texto no normalizado que muestra información sobre el producto derivado

Importe: Es el importe nominal comprometido expresado en euros.

Objetivo: Este campo puede tener las siguientes posibilidades de cumplimentación:

- o1- Cobertura
- o2- Inversión
- o3- Objetivo concreto de rentabilidad