



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

DEPARTAMENTO DE ESTUDIOS, ESTADÍSTICAS Y PUBLICACIONES

27 de abril de 2017

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 FONDTRIM

La información contenida se presenta en 38 campos de los que 6 son identificativos de la IIC o del periodo de referencia. Los campos identificativos sirven para vincularse con FONDREGISTRO que contiene un amplio número de campos descriptivos y clasificatorios de la IIC.

Se trata de un fichero de periodicidad trimestral.

Suministra información sobre el valor liquidativo y el patrimonio a fin de trimestre, las rentabilidades obtenidas considerando distintos plazos, las comisiones que cobra el fondo (las nominales establecidas en folleto y/o las devengadas durante el trimestre).

La información se facilita a nivel de clase, compartimento o fondo, según sea el caso.

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

Campos del fichero

FechaDatos: Fecha de referencia de los demás campos. En los campos correspondientes a datos de flujo, la fecha se refiere al trimestre que finaliza en la misma.

Tipo: Tipo de IIC.

NumeroRegistro: Número de registro del fondo de inversión en la CNMV.

CodigoDivisaIIC: Divisa de denominación del fondo de inversión.

NumeroCompartimento: Número de registro del compartimento en la CNMV.

ClaseFondo: El contenido de este campo puede tener las siguientes posibilidades:

- Fondo que replica o reproduce un índice.
- Fondo que toma como referencia un índice.
- Fondo subordinado de IIC nacional.
- Fondo subordinado de IIC extranjera.
- Fondo constituido bajo convenios con el Estado y CCAA o cualquier otra institución.
- Fondo que invierte más del 10% en otros fondos y/o sociedades.
- Fondo que invierte mayoritariamente en otros fondos y/o sociedades.
- Otros. Cuando el fondo no pertenece a ninguna de las categorías anteriores.

VocacionInversora: La cumplimentación de este campo puede tener las siguientes posibilidades:

Monetario
Monetario a corto plazo
Renta Fija Euro
Renta Fija Internacional
Renta Fija Mixta Euro
Renta Fija Mixta Internacional
Renta Variable Mixta Euro
Renta Variable Mixta Internacional
Renta Variable Euro
Renta Variable Internacional
IIC de Gestión Pasiva
Garantizado de rendimiento fijo
Garantizado de rendimiento variable
De garantía parcial
Retorno Absoluto
Global

NumeroClase: Número de registro de la clase en la CNMV.

ISIN: ISIN del fondo, del compartimento o de la clase.

CodigoDivisa: Divisa de denominación de la clase.

NumeroParticipaciones: Número de participaciones a fin de periodo de la clase o del compartimento o del fondo

NumeroParticipes: Número de partícipes a fin de periodo de la clase o del compartimento o del fondo

Beneficio_Dividendo_Bruto: Beneficios brutos distribuidos por participación en unidades y en divisa de denominación de la clase o del compartimento o del fondo.

Patrimonio: Patrimonio a fin de periodo en unidades y en divisa de denominación de la clase o del compartimento o del fondo.

ValorLiquidativo: Valor liquidativo de la participación a fin de periodo en unidades y en divisa de denominación de la clase o del compartimento o del fondo.

ComisionGestion: Comisión de gestión efectivamente devengada durante el periodo. Presentada en porcentaje. Es la suma de la comisión de gestión sobre patrimonio y la comisión de gestión sobre resultados, calculadas ambas sobre el patrimonio medio diario durante el período de referencia de la clase o en su caso del compartimento o del fondo. El periodo de referencia es un

semestre cuando se trata de los ficheros de junio y diciembre y de un trimestre en los ficheros de marzo y septiembre.

BaseCalculo ComisionGestion: Este campo puede tener las siguientes posibilidades:

Patrimonio
Resultados
Mixta

ComisionDepositario: Comisión de depósito efectivamente devengada durante el periodo. Presentada en porcentaje. Se calcula sobre patrimonio medio diario de la clase, o en su defecto del compartimento o del fondo, durante el período de referencia.

SistemaImputacionComisiones: Este campo puede tener las siguientes posibilidades:

Al fondo
Individual

ComisionSuscripcionMaxima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de suscripción a favor de la gestora, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de suscripción se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

ComisionSuscripcionMinima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de suscripción a favor de la gestora, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de suscripción se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

ComisionReembolsoMaxima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de reembolso a favor de la gestora, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de suscripción se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

ComisionReembolsoMinima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de reembolso a favor de la gestora, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de suscripción se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

ComisionDescuentoFavorFondoMaxima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de descuento a favor del fondo, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de suscripción se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

ComisionDescuentoFavorFondoMinima: En este campo se indica el porcentaje que, en concepto de comisión de descuento a favor del fondo, hayan efectivamente soportado los partícipes. En caso de que la comisión de descuento se aplique por tramos la máxima y mínima serán diferentes.

Rentabilidad TrimestreActual: Rentabilidad sin anualizar del trimestre T (último trimestre). En porcentaje. Este campo podrá aparecer en blanco debido a que no existan datos suficientes para su cálculo en el periodo completo de que se trate (por ejemplo si a la fecha de final del periodo anterior la clase (o compartimento o fondo) no estuviera dada de alta o si dentro del periodo se hubiera producido un cambio de política inversora, ya que sólo se informa de la rentabilidad para los periodos con política de inversión homogénea. Esto también afecta a los tres campos siguientes también referidos a rentabilidad.

Rentabilidad T_1: Rentabilidad sin anualizar del trimestre T -1. En porcentaje.

Rentabilidad T_2: Rentabilidad sin anualizar del trimestre T -2. En porcentaje.

Rentabilidad T_3: Rentabilidad sin anualizar del trimestre T -3. En porcentaje.

PeriodicidadCalculoVL: Periodicidad del cálculo del valor liquidativo puede ser:

Diaria
Semanal
Quincenal
Otros

Volatilidad TrimestreActual: Volatilidad histórica del trimestre T (último trimestre) (en %). Indica el riesgo de un valor en un periodo. Tanto este campo como los siguientes de volatilidad podrán aparecer en blanco en caso en que no existan datos suficientes para su cálculo en el periodo completo de que se trate, debido a que a la fecha de final del periodo anterior no estuviera dada de alta la clase, el compartimento o la IIC de que se trate. Si dentro de un periodo se ha producido un cambio de política inversora también aparecerá en blanco ya que sólo se informa de la volatilidad para los periodos con política de inversión homogénea.

Volatilidad T_1: Volatilidad histórica del trimestre T -1. En porcentaje.

Volatilidad T_2: Volatilidad histórica del trimestre T -2. En porcentaje.

Volatilidad T_3: Volatilidad histórica del trimestre T -3. En porcentaje.

RatioTotalGastos TrimestreActual: Ratio total de gastos del trimestre T (último trimestre). Se refiere a los gastos de explotación en el periodo. Viene expresado en % sobre patrimonio medio diario del fondo, del compartimento o de la clase según sea el caso.

Incluye los gastos directos soportados en el periodo de referencia: comisión de gestión sobre patrimonio, comisión de depositario, auditoría, servicios bancarios (salvo gastos de financiación), y resto de gastos de gestión corriente.

Aunque estos ficheros comienzan con datos relativos al año 2012, hay que hacer dos advertencias por si alguien dispusiera de información anterior obtenida de la publicada en nuestra web en el periodo correspondiente: (i) desde Diciembre de 2011 este ratio no incluye la comisión de gestión sobre resultados ni los costes de transacción por la compraventa de valores, (ii) desde diciembre de 2011, en el caso de fondos/compartimentos que invierten más de un 10% de su patrimonio en otras IIC se incluyen también los gastos soportados indirectamente derivados de esas inversiones, que incluyen las comisiones de suscripción y de reembolso.

RatioTotalGastos T_1: Igual que el **RatioTotalGastos TrimestreActual** pero referido al trimestre T -1.

RatioTotalGastos T_2: Igual que el **RatioTotalGastos TrimestreActual** pero referido al trimestre T -2.

RatioTotalGastos T_3: Igual que el **RatioTotalGastos TrimestreActual** pero referido al trimestre T -3.