



REQUISITOS TÉCNICOS DEL INFORME SEMESTRAL DE CUMPLIMIENTO DE LA FUNCIÓN DE VIGILANCIA Y SUPERVISIÓN DE LOS DEPOSITARIOS DE INSTITUCIONES DE INVERSIÓN COLECTIVA.

Índice

1. PRESENTACIÓN DE LA INFORMACIÓN	2
1. PROCEDIMIENTO TÉCNICO	3
2. VALIDACIONES DE LA INFORMACIÓN RECIBIDA	5

Apartado 1. **Presentación de la información**

Los depositarios de instituciones de inversión colectiva deberán presentar el informe semestral a través del trámite_ISD del “servicio CIFRADO/CNMV” de la oficina virtual, aprobado por Acuerdo del Consejo de la CNMV de 15 de septiembre de 2006.

Deberán enviar un informe por cada gestora de cuyas IIC sean depositarios en cada semestre natural. De este modo, al cabo del año habrá por cada gestora dos informes semestrales cuyas fechas de referencia serán junio y diciembre.

La obligación de cumplimentar el informe por cada gestora recae sobre las entidades que, a último día del semestre en cuestión, figuren en los registros de la CNMV como depositarios de instituciones de inversión colectiva de la gestora correspondiente. Así, pueden existir varios depositarios que realicen los citados informes sobre la misma gestora cuando ésta tiene confiadas las funciones de depositaría para distintas IIC en diferentes entidades.

En el caso de sustitución del depositario en mitad de un semestre, el informe debe enviarlo el depositario que figure en los registros de CNMV el último día del semestre de referencia por las incidencias detectadas durante el período comprendido desde su designación hasta el último día del semestre.

La información presentada deberá suscribirse por persona que posea facultades para ello.

El plazo máximo para la presentación de la información será el que se contiene en la Norma 11^a de la Circular 4/2016, de 29 de junio, de la Comisión Nacional del Mercado de Valores, sobre las funciones de los depositarios de instituciones de inversión colectiva y entidades reguladas por la Ley 22/2014, de 12 de noviembre, por la que se regulan las entidades de capital-riesgo, otras entidades de inversión colectiva de tipo cerrado y las sociedades gestoras de entidades de inversión colectiva de tipo cerrado, y por la que se modifica la Ley 35/2003, de 4 de noviembre, de Instituciones de Inversión Colectiva.

Apartado 2. Procedimiento técnico y definición del fichero a enviar (.XML)

Los pasos a dar para remitir la información a la CNMV se detallan a continuación:

Preparar un fichero .XML de acuerdo con la definición y esquema siguientes (importante: la CNMV no entregará aplicación o plantilla informática para la preparación de este fichero):

Esquema del fichero .XML

Para descargar un fichero a disco, pulse el botón derecho del ratón y seleccione "Guardar destino como...".

Este fichero .XML se firma electrónicamente para su envío a la CNMV, todo ello de acuerdo con lo indicado en el trámite ISD del servicio CIFRADO/CNMV.

Si el envío cumple todo lo indicado, el remitente recibirá en pantalla una referencia del trámite y posteriormente un mensaje de Acuse de Recibo.

Verificar el Acuse de Recibo. El Acuse de recibo le indicará el número, fecha y hora asignados al envío en el registro de entrada.

Si en el plazo de un día no ha recibido el Acuse de recibo debe ponerse en contacto con la oficina virtual de la CNMV.

Si el envío no cumple los requisitos especificados, en vez de un Acuse de recibo recibirá un mensaje detallado con la circunstancia de incumplimiento detectada.

De acuerdo con el texto del mensaje, revise todos los pasos realizados, haga las correcciones necesarias y vuelva a hacer el envío.

Enviado el Acuse de recibo, la información contenida en el fichero electrónico será sometida en la CNMV a una primera revisión que servirá para determinar si dicha información cumple con todos los aspectos formales. Esta primera revisión se efectuará de acuerdo con lo señalado en el Apartado 3 de Validaciones de la información.

Una vez aplicados los procesos descritos en el párrafo anterior, la CNMV enviará un correo electrónico a los firmantes del envío, indicándoles el resultado de dichos procesos para cada una de las IIC contenidas en el envío. Dicho correo contendrá el número de registro de entrada que fue asignado al envío y confirmará la recepción los informes de aquellas gestoras/SICAV autogestionadas en las que no se hubieran detectado incidencias (Mensaje especificando el número de registro de las gestoras/SICAV autogestionadas para las que la información remitida ha pasado todos los controles de recepción). En caso de que se hubieran detectado incidencias en algunas gestoras/SICAV autogestionadas, se indicará que, para éstas, el envío no es

conforme, con indicación y descripción de aquellos controles, cuadros o filtros que hubieran determinado ese resultado.

La información presentada que reciba un mensaje de conformidad, se incorporará a los ficheros de la CNMV a los efectos de su supervisión. El depositario de IIC, deberá efectuar un segundo envío de la información que no haya resultado conforme, que deberá cumplir con todos los requisitos señalados anteriormente.

Apartado 3. Validaciones de la información recibida

La información contenida en el fichero electrónico será sometida a una serie de validaciones para verificar que cumple todos los requisitos contenidos en los siguientes subapartados.

3.1 Validación de conjunto

La información enviada por cada gestora/SICAV autogestionada comprenderá todos los modelos correspondientes al semestre de referencia de la información.

3.2 Validaciones de formato y campos de datos

El campo de TIPO de IIC en los modelos Do1, Do2, Do3 será: FI, SICAV, FHF, SHF, FIL, SIL o FII.

El campo de Nº REGISTRO DE IIC/ COMPARTIMENTO: será el número que consta en los registros de la CNMV. En caso de IICs por compartimentos se cumplimentará el número de IIC y el número de compartimento. Para IICs sin compartimentos se cumplimentará el número de IIC y se dejará la etiqueta de compartimento a cero.

En los modelos Do1, Do2, Do3 y Do4 cada línea de registro está formada por varios campos. En caso de que no fuera pertinente la cumplimentación de alguno de estos campos:

Si el campo es de texto, alfanumérico o fecha, se dejará en blanco.

Si el campo es numérico, se cumplimentará con un cero.

La información relativa a:

Los datos de número de incidencias/diferencias/incumplimientos y los respectivos de importe, impacto, antigüedad, fecha y observaciones se cumplimentarán siguiendo los criterios de la siguiente tabla:

Columna	Forma de cumplimentación
Nº incidencias/diferencias	Número entero sin decimales
Importe incidencia/diferencia	En euros con dos decimales, con su signo
Impacto	En porcentaje con dos decimales, con su signo

Fechas	Formato dd-mm-aaaa
Antigüedad media	Número de días redondeados con equidistancia al alza
Observaciones de la gestora	Campo alfanumérico con límite 250 caracteres

La información se cumplimentará con signo positivo, salvo para las columnas de 5, 6, 9 y 10 del Modelo Do2 y columnas 4, 5, 8 y 9 del modelo Do3 que irán cada una con su signo correspondiente dentro de la “subcolumna” (+/-).

En los modelos Do2, Do3 y Do4 en la última posición se totalizarán las diferencias, incidencias o incumplimientos comunicados. Se cumplimentarán los datos con la suma de las filas anteriores para columnas(5) del Do1, (4) y (8) del Do2, (3) y (7) del Do3 y (2) y (4) del Do4. La columna (1) de todos los modelos se cumplimentarán con ZZZZZ. El total de resto de columnas no se cumplimentará.

Modelo Do1

Columna (3). Código ISIN. En caso de que el valor en el que se produzca la incidencia no tuviera código ISIN, este campo se cumplimentará con un código de 5 posiciones, el primero será la letra V y los siguientes números, que se asignarán secuencialmente.

Ej: V0001, V0002, V0003...

Modelo Do5

Todas las claves son campos alfanuméricos con límite de 75 caracteres.