KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2018/708

af 17. april 2018

om gennemførelsesmæssige tekniske standarder vedrørende det skema, der skal anvendes af forvaltere af pengemarkedsforeninger ved indberetning til de kompetente myndigheder, jf. artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1131

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1131 af 14. juni 2017 om pengemarkedsforeninger ([1]), særlig artikel 37, stk. 4, og

ud fra følgende betragtninger:

(1) Der er behov for indberetningskrav ud over dem, der er fastsat ved Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF ([2]) og 2011/61/EU ([3]), med henblik på at sikre, at de kompetente myndigheder effektivt kan opdage, overvåge og reagere på risici på markedet for pengemarkedsforeninger (MMF'er).

(2) I henhold til artikel 37 i forordning (EU) 2017/1131 skal MMF'er indberette en detaljeret liste med oplysninger til deres kompetente myndigheder. For at sikre, at der er sammenhæng i den måde, disse myndigheder indsamler de relevante oplysninger på, i hele Den Europæiske Union, og at de pågældende myndigheder er orienteret om den vigtigste udvikling på MMF-markedet, med mulighed for at gøre det lettere at foretage en kollektiv analyse af de potentielle virkninger af MMF-markedet i Unionen, er det nødvendigt, at oplysningerne fremlægges for de kompetente myndigheder på ensartet vis i hele EU. Desuden gør brug af et standardindberetningsskema det lettere at gennemføre de procedurer og processer, indberetningskravene til MMF'er er forbundet med, ligesom de dermed forbundne omkostninger minimeres.

(3) Med det formål at sikre et effektivt tilsyn i Unionen skal de relevante oplysninger videresendes til Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) med henblik på oprettelse af en central database over MMF'er.

(4) Denne forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som ESMA har forelagt Kommissionen.

(5) ESMA har gennemført en åben offentlig høring om det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de potentielle omkostninger og fordele i forbindelse hermed samt anmodet interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 ([4]), om en udtalelse.

(6) Den dato, hvorfra denne gennemførelsesforordning finder anvendelse, bør være den samme som den dato, hvorfra forordning (EU) 2017/1131 finder anvendelse, så de nationale myndigheder har mulighed for at samle de oplysninger, der skal fremsendes til ESMA's database, jf. artikel 37, stk. 5, i forordning (EU) 2017/1131 —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Forvaltere af pengemarkedsforeninger (MMF'er) anvender skemaet i bilaget til denne forordning, når de indberetter oplysninger til en MMF's kompetente myndighed, jf. artikel 37 i forordning (EU) 2017/1131.

([1]) EUT L 169 af 30.6.2017, s. 8.
([2]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/65/EF af 13. juli 2009 om samordning af love og administrative bestemmelser om visse institutter for kollektiv investering i værdipapirer (investeringsinstitutter) (omarbejdning) (EUT L 302 af 17.11.2009, s. 32).
([3]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2011/61/EU af 8. juni 2011 om forvaltere af alternative investeringsfonde og om ændring af direktiv 2003/41/EF og 2009/65/EF samt forordning (EF) nr. 1060/2009 og (EU) nr. 1095/2010 (EUT L 174 af 1.7.2011, s. 1).
([4]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

Artikel 2

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Den anvendes fra den 21. juli 2018.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 17. april 2018.

På Kommissionens vegne

Jean-Claude JUNCKER

Formand

BILAG

Indberetningsskema for forvaltere af pengemarkedsforeninger (MMF'er)

Medmindre andet er angivet, angives alle tal på afdelingsniveau

Punkt	Datatype	Indberettede data
(A) Alle MMF'er		
	(1) **Generelle karakteristika, identifikation af MMF'en og forvalteren af MMF'en**	
(A.1.1)	Indberetningsperiode	
(A.1.2)	MMF'ens nationale kode som tildelt af MMF'ens kompetente myndighed	
(A.1.3)	MMF'ens LEI-kode	Kode i henhold til ISO 17442 Legal Entity Identifier (LEI), 20 alfanumeriske tegn
(A.1.4)	MMF'ens ECB-kode (MFI-ID-kode)	
(A.1.5)	MMF'ens navn	
(A.1.6)	Angiv, om MMF'en er en UCITS eller en AIF	UCITS AIF
(A.1.7)	Angiv, om MMF'en udelukkende markedsføres gennem en medarbejderopsparingsordning, der er omfattet af national ret, og som har fysiske personer som investorer (jf. artikel 16, stk. 5, i forordning (EU) 2017/1131 [1]).	(Ja/Nej)
(A.1.8)	MMF'ens hjemsted	ISO 3166 — Landekode
(A.1.9)	Medlemsstat, hvor MMF'en er meddelt tilladelse	ISO 3166 — Landekode
(A.1.10)	Medlemsstater, hvor MMF'en markedsføres	Liste over lande (ISO 3166 — Landekode)
(A.1.11)	Dato for MMF'ens etablering	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(A.1.12)	MMF'ens basisvaluta	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)

[1] Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1131 af 14. juni 2017 om pengemarkedsforeninger

Punkt		Datatype	Indberettede data
	(A.1.13)	MMF'ens forvalters nationale kode som tildelt af MMF'ens kompetente myndighed	
	(A.1.14)	MMF'ens forvalters nationale kode som tildelt af MMF'ens forvalters kompetente myndighed	
	(A.1.15)	MMF'ens forvalters LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
	(A.1.16)	MMF'ens forvalters ECB-kode (MFI-ID-kode)	
	(A.1.17)	Navnet på MMF'ens forvalter	
	(A.1.18)	Land, hvor MMF'ens forvalter er meddelt tilladelse	
	(A.1.19)	MMF'ens depositars LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
	(A.1.20)	MMF'ens depositars nationale kode	
	(A.1.21)	MMF'ens depositars juridiske navn	
	(2) **Type MMF**		
	(A.2.1)	MMF-type [Vælg én]	MMF med variabel nettoaktivværdi og kort løbetid Statsgældsbaseret MMF med konstant nettoaktivværdi og kort løbetid MMF med nettoaktivværdi med lav volatilitet og kort løbetid Standard-MMF med variabel nettoaktivværdi
	(3) **Andre karakteristika ved MMF'en**		
	a) *Master-/feeder-information* (MMF'en markedsføres udelukkende gennem en medarbejderopsparingsordning, der er omfattet af national ret, og som har fysiske personer som investorer)		
	(A.3.1)	Hvis MMF'en opfylder betingelserne i artikel 16, stk. 5, i forordning (EU) 2017/1131, angives det, om MMF'en er en master- eller en feederfond [Vælg én]	Master Feeder
	Hvis MMF'en er en feederfond:		
	(A.3.2)	MMF'ens masterfonds LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)

Punkt	Datatype	Indberettede data
(A.3.3)	MMF'ens masterfonds nationale kode	
(A.3.4)	MMF'ens masterfonds juridiske navn	
b) *Oplysninger om kapitalandelsklasser*		
(A.3.5)	Angiv, om MMF'en har kapitalandelsklasser	(Ja/Nej)
(A.3.6)	Hvis MMF'en har kapitalandelsklasser, angives ISIN-koden for hver enkelt kategori af kapitalandele	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
(A.3.7)	Hvis MMF'en har kapitalandelsklasser, angives valutaen for de forskellige kategorier af kapitalandele	ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn)
c) *Oplysninger om den ophørte eller likviderede fond (engangsindberetning)*		
Hvis MMF'en er fusioneret med en anden fond, angives følgende:		
(A.3.8)	Fusionsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
Hvis MMF'en er likvideret, angives følgende:		
(A.3.9)	Likvidationsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(4) **MMF'ens porteføljeindikatorer**		
a) *Samlet aktivværdi (for så vidt angår indberetningsskemaet i henhold til MMR-forordningen lægges der til grund, at den samlede aktivværdi svarer til nettoaktivværdien — se A.4.1 nedenfor)*		
b) *Nettoaktivværdi (afdelingsniveau — ikke kapitalandelsklasse)*		
(A.4.1)	MMF'ens nettoaktivværdi (afdelingsniveau)	(EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.4.2)	MMF'ens nettoaktivværdi	(i basisvaluta)
c) *WAM*		
(A.4.3)	MMF'ens vægtede gennemsnitlige renteløbetid beregnet som fastsat i artikel 2, nr. 19), i forordning (EU) 2017/1131	(dage)

Punkt		Datatype	Indberettede data
	d) *WAL*		
	(A.4.4)	MMF'ens vægtede gennemsnitlige restlevetid beregnet som fastsat i artikel 2, nr. 20), artikel 24, stk. 1, litra b), og artikel 25, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/1131.	(dage)
	e) *Likviditetsindikatorer*		
	Porteføljens likviditetsprofil		
	(A.4.5)	% af aktiverne, der opfylder betingelserne for den daglige likviditetsbuffer (aktiver med udløb inden for en dag som defineret i artikel 24 og 25 i forordning (EU) 2017/1131)	%
	(A.4.6)	% af aktiver, der opfylder betingelserne for den ugentlige likviditetsbuffer (aktiver med udløb inden for en uge som defineret i artikel 24 og 25 i forordning (EU) 2017/1131)	%
	(A.4.7)	Porteføljens likviditetsprofil	Procentdel af porteføljen, der kan likvideres inden for hver periode
Periode	1 dag eller mindre [ ] 2-7 dage [ ] 8-30 dage [ ] Over 30 dage [ ]		
	f) *Afkast*		
	(A.4.8)	Samlet afkast	%
Interval	ÅTD-afkast [ ] 1 måned [ ] 3 måneder [ ] 1 år [ ] 3 år [ ] 5 år [ ]		
	(A.4.9)	Resultater (kalenderåret — nettoafkast) for den mest repræsentative kapitalandelsklasse	%
Interval	År N-1 [ ] År N-2 [ ] År N-3 [ ]		
	(A.4.10)	Månedlig porteføljevolatilitet og månedlig porteføljevolatilitet for skyggenettoaktivværdien (hvis relevant)	%
Interval	1 år [ ] 2 år [ ] 3 år [ ]		

Punkt	Datatype	Indberettede data
(5) **Stresstest af MMF'en**		
a) *Resultater af stresstestene af MMF'en*		
(A.5.1)	Resultaterne af MMF'ens likviditetsstresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.2)	Resultaterne af MMF'ens kreditstresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.3)	Resultaterne af MMF'ens valutakursstresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.4)	Resultaterne af MMF'ens rentesatsstresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.5)	Resultaterne af MMF'ens stresstest af indløsningsniveauer gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.6)	Resultaterne af MMF'ens stresstest af spændet mellem de indekser, som rentesatserne for porteføljeværdipapirerne er tilknyttet, gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
(A.5.7)	Resultaterne af MMF'ens makrostresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	

Punkt		Datatype	Indberettede data
	(A.5.8)	Resultaterne af MMF'ens multivariate stresstest gennemført i indberetningsperioden, jf. artikel 28, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 og de relevante retningslinjer fra ESMA om stresstestscenarier	
	(A.5.9)	For MMF'er med konstant nettoaktivværdi og MMF'er med nettoaktivværdi med lav volatilitet angives resultaterne af stresstest angivet i A.5.1-A.5.8 for så vidt angår forskel mellem den konstante nettoaktivværdi pr. andel eller kapitalandel og nettoaktivværdien pr. andel eller kapitalandel	
	b) *Forslag til handlingsplan (hvis relevant)*		
	(A.5.10)	Beskriv forslaget til handlingsplan, jf. artikel 28, stk. 4, i forordning (EU) 2017/1131	Fri tekst
	(6) **Oplysninger om aktiverne i MMF'ens portefølje**		
	a) *Pengemarkedsinstrumenter, investerbare securitiseringer og gældsbreve med sikkerhed i konkrete aktiver*		
	Nedenstående felter under A.6 udfyldes ved hjælp af et detaljeret indberetningsskema		
	(A.6.1)	Type pengemarkedsinstrument, investerbare securitiseringer og gældsbreve med sikkerhed i konkrete aktiver [Vælg én eller flere]	
		Angiv typen af pengemarkedsinstrumenter, investerbare securitiseringer og gældsbreve med sikkerhed i konkrete aktiver	Pengemarkedsinstrumenter, jf. artikel 10 i forordning (EU) 2017/1131 Securitiseringer som omhandlet i artikel 13 i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/61 ([2]) Gældsbreve med sikkerhed i konkrete aktiver som omhandlet i artikel 11, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/1131 Simpel, transparent og standardiseret securitisering eller gældsbreve med sikkerhed i konkrete aktiver som omhandlet i artikel 11, stk. 1, litra c), i forordning (EU) 2017/1131
		Hvis aktivtypen er et pengemarkedsinstrument, udfyldes A.6.2-A.6.20	
	(A.6.2)	Aktivbeskrivelse af pengemarkedsinstrumentet	
	(A.6.3)	Pengemarkedsinstrumentets ISIN-kode	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)

([2]) Kommissionens delegerede forordning (EU) 2015/61 af 10. oktober 2014 om supplerende regler til forordning (EU) nr. 575/2013 for så vidt angår likviditetsdækningskrav for kreditinstitutter (EUT L 11 af 17.1.2015, s. 1).

Punkt	Datatype	Indberettede data
(A.6.4)	Pengemarkedsinstrumentets CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger)	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
(A.6.5)	Emittentens LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.6)	Emittentens navn	
(A.6.7)	Emittentkategori Emittentkategorien vælges fra listen [Vælg én]	Stat (EU) Stat (ikke EU) EU-centralbank Ikke-EU-centralbank Regional myndighed Lokal myndighed Nationalt offentligt organ Offentligt organ, EU (bortset fra nationale offentlige organer) Offentligt organ, ikke EU Overnationalt offentligt organ (EU) Overnationalt offentligt organ (bortset fra EU) Kreditinstitut Andre finansielle selskaber Ikke-finansielle selskaber
(A.6.8)	Land — emittenten af pengemarkedsinstrumentet	ISO 3166 — Landekode
(A.6.9)	Udløbsdato for pengemarkedsinstrumentet	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(A.6.10)	Pengemarkedsinstrumentet — valuta	(ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn))
(A.6.11)	Pengemarkedsinstrumentet — mængde	
(A.6.12)	Pengemarkedsinstrumentet — clean price	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.13)	Pengemarkedsinstrumentet — clean price	(i basisvaluta)
(A.6.14)	Påløbne renter	

Punkt		Datatype	Indberettede data
	(A.6.15)	Påløbne renter	(i basisvaluta, hvis A.6.14 er i EUR)
	(A.6.16)	Samlet markedsværdi af pengemarkedsinstrumentet	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(A.6.17)	Samlet markedsværdi af pengemarkedsinstrumentet	(i basisvaluta)
	(A.6.18)	Metode, der er anvendt til prisfastsættelse af pengemarkedsinstrumentet	opgørelse til markedsværdi opgørelse til modelværdi opgørelse til amortiseret kostpris
	(A.6.19)	Angiv, om resultatet af den interne kreditvurderingsprocedure er positivt eller negativt	(positivt/negativt)
	(A.6.20)	Angiv næste rentetilpasningsdag (jf. artikel 10, stk. 2, i forordning (EU) 2017/1131)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
		Hvis aktivtypen er en investerbar securitisering eller et investerbart gældsbrev med sikkerhed i konkrete aktiver, udfyldes A.6.21-A.6.37	
	(A.6.21)	Aktivbeskrivelse af den investerbare securitisering eller det investerbare gældsbrev med sikkerhed i konkrete aktiver	
	(A.6.22)	ISIN-kode for den investerbare securitisering eller det investerbare gældsbrev med sikkerhed i konkrete aktiver	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
	(A.6.23)	Land — sponsoren til den investerbare securitisering/det investerbare gældsbrev med sikkerhed i konkrete aktiver	ISO 3166 — Landekode
	(A.6.24)	Sponsorens LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
	(A.6.25)	Sponsorens navn	
	(A.6.26)	Type underliggende	Tilgodehavender fra salg Forbrugslån Leasing Fordringer på kreditkort Lån til selskaber/SMV'er Pant i beboelsesejendom Pant i erhvervsejendom Andre aktiver

Punkt		Datatype	Indberettede data
	(A.6.27)	Udløbsdato	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
	(A.6.28)	Valuta	(ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn))
	(A.6.29)	Mængde	
	(A.6.30)	Clean price	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(A.6.31)	Clean price	(i basisvaluta)
	(A.6.32)	Påløbne renter	
	(A.6.33)	Påløbne renter	(i basisvaluta, hvis A.6.30 er i EUR)
	(A.6.34)	Samlet markedsværdi	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(A.6.35)	Samlet markedsværdi	(i basisvaluta)
	(A.6.36)	Metode, der er anvendt til prisfastsættelse af den investerbare securitisering/det investerbare gældsbrev med sikkerhed i konkrete aktiver	opgørelse til markedsværdi opgørelse til modelværdi opgørelse til amortiseret kostpris
	(A.6.37)	Angiv, om resultatet af den interne kreditvurderingsprocedure er positivt eller negativt	(positivt/negativt)
	b) *Andre aktiver*		
	(A.6.38)	Type Andre aktiver [Vælg én] Typen af andre aktiver vælges fra listen, jf. artikel 9 i forordning (EU) 2017/1131	Indlån i kreditinstitutter som omhandlet i artikel 12 i forordning (EU) 2017/1131 Omvendte genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 15 i forordning (EU) 2017/1131 Genkøbsaftaler som omhandlet i artikel 14 i forordning (EU) 2017/1131 Andele eller kapitalandele i andre MMF'er som omhandlet i artikel 16 i forordning (EU) 2017/1131

Punkt		Datatype	Indberettede data
			Afledte finansielle instrumenter som omhandlet i artikel 13 i forordning (EU) 2017/1131 — henholdsvis: — Afledte finansielle instrumenter, der handles på et reguleret marked (angiv, om instrumentet falder ind under artikel 50, stk.1, litra a), b) eller c), i direktiv 2009/65/EF) — Afledte finansielle instrumenter, der handles over-the-counter Supplerende likvide aktiver (jf. artikel 50, stk. 2, i direktiv 2009/65/EF)
		Hvis typen af andre aktiver er et afledt finansielt instrument, udfyldes A.6.39-A.6.60	
	(A.6.39)	Type derivataftale	
	(A.6.40)	Det afledte finansielle instruments ISIN-kode	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
	(A.6.41)	Det afledte finansielle instruments UPI-nummer (hvis ISIN-koden ikke foreligger)	
	(A.6.42)	Det afledte finansielle instruments FISN-kode (det finansielle instruments navn i kortform)	ISO 18774
	(A.6.43)	Det afledte finansielle instruments CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger)	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
	(A.6.44)	Type afledt instrument som omhandlet i artikel 13, litra a), i forordning (EU) 2017/1131 [Vælg én]	rentesats valutaer rentesatsindekser valutaindekser
	(A.6.45)	Navn på det underliggende	
	(A.6.46)	Type identifikation af det underliggende ([3])	I = ISIN X = Indeks

([3]) Identifikation af det afledte finansielle instrument i EMIR.

Punkt	Datatype	Indberettede data
(A.6.47)	Identifikation af det underliggende	Til identifikation af det underliggende, type I: ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode) Til identifikation af det underliggende, type X: ISIN-kode i henhold til ISO 6166, 12-tegns alfanumerisk kode, hvis den foreligger, og ellers indeksets fulde navn som tildelt af indeksudbyderen
(A.6.48)	Valuta for notionel værdi 1 ([4])	ISO 4217-valutakode
(A.6.49)	Valuta for notionel værdi 2 ([5])	ISO 4217-valutakode
(A.6.50)	Land — det afledte finansielle instrument	ISO 3166 — Landekode
(A.6.51)	Udløbsdato for det afledte finansielle instrument	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(A.6.52)	Det afledte finansielle instruments eksponering	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.53)	Det afledte finansielle instruments eksponering	(i basisvaluta)
(A.6.54)	Markedsværdi af det afledte finansielle instrument	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.55)	Markedsværdi af det afledte finansielle instrument	(i basisvaluta)
(A.6.56)	Markedsværdi af den modtagne sikkerhed (i tilknytning til det afledte finansielle instrument)	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.57)	Markedsværdi af den modtagne sikkerhed (i tilknytning til det afledte finansielle instrument)	(i basisvaluta)
(A.6.58)	Angiv næste rentetilpasningsdag (jf. artikel 10, stk. 2, i forordning (EU) 2017/1131)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(A.6.59)	Modpartens navn	
(A.6.60)	Modpartens LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)

([4]) Valutaen for det notionelle beløb. Hvis der er tale om en rentederivataftale, vil dette være den notionelle valuta for første ben.
([5]) Valutaen for det notionelle beløb. Hvis der er tale om en rentederivataftale, vil dette være den notionelle valuta for andet ben

Punkt	Datatype	Indberettede data
	Hvis typen af andre aktiver er en andel eller kapitalandel i en anden MMF, udfyldes A.6.61-A.6.71	
(A.6.61)	Aktivbeskrivelse af andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	
(A.6.62)	ISIN-kode for andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.63)	LEI-koden (hvis ISIN-koden ikke foreligger) for andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	
(A.6.64)	CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger) for andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
(A.6.65)	Valuta	(ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn))
(A.6.66)	Land — andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	ISO 3166 — Landekode
(A.6.67)	Markedsværdien af andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.68)	Markedsværdien af andelen eller kapitalandelen i en anden MMF	(i basisvaluta)
(A.6.69)	Mængde	
(A.6.70)	Prisen for andelen eller kapitalandelen i en anden MMF (nettoaktivværdien pr. andel eller kapitalandel i en anden MMF)	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.71)	Prisen for andelen eller kapitalandelen i en anden MMF (nettoaktivværdien pr. andel eller kapitalandel i en anden MMF)	(i basisvaluta)
	Hvis typen af andre aktiver er et indlån eller supplerende likvide aktiver, udfyldes A.6.72-A.6.81	
(A.6.72)	Aktivbeskrivelse af indlånet eller de supplerende likvide aktiver	
(A.6.73)	ISIN-kode for indlånet eller de supplerende likvide aktiver	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.74)	CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger) for indlånet eller de supplerende likvide aktiver	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
(A.6.75)	Land — indlånet eller de supplerende likvide aktiver	ISO 3166 — Landekode

Punkt	Datatype	Indberettede data
(A.6.76)	Modpartens navn	
(A.6.77)	Modpartens LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.78)	Udløbsdato for indlånet eller de supplerende likvide aktiver	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
(A.6.79)	Valuta	(ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn))
(A.6.80)	Indlånets eller de supplerende likvide aktivers eksponering	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.81)	Indlånets eller de supplerende likvide aktivers eksponering	(i basisvaluta)
	Hvis typen af andre aktiver er en genkøbsaftale eller en omvendt genkøbsaftale, udfyldes A.6.82-A.6.99	
(A.6.82)	Aktivbeskrivelse af genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale	
(A.6.83)	ISIN-kode for genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.84)	CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger) for genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
(A.6.85)	Land — genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale	ISO 3166 — Landekode
(A.6.86)	Kategori af modpart Modpartskategorien vælges fra listen (jf. artikel 20, stk. 2, litra e), i forordning (EU) 2017/1131) [Vælg én]	Stat (EU) Stat (ikke EU) EU-centralbank Ikke-EU-centralbank Regional myndighed Lokal myndighed Nationalt offentligt organ Offentligt organ, EU (bortset fra nationale offentlige organer) Offentligt organ, ikke EU Overnationalt offentligt organ (EU) Overnationalt offentligt organ (bortset fra EU)

Punkt		Datatype	Indberettede data
			Kreditinstitut Andre finansielle selskaber Ikke-finansielle selskaber
	(A.6.87)	Modpartens LEI-kode	LEI-kode i henhold til ISO 17442 (20-tegns alfanumerisk kode)
	(A.6.88)	Modpartens navn	
	(A.6.89)	Udløbsdato for genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
	(A.6.90)	Valuta	(ISO 4217-valutakode (bogstavkode bestående af 3 tegn))
	(A.6.91)	Genkøbsaftalens eller en omvendt genkøbsaftales eksponering (i tilfælde af en omvendt genkøbsaftale er dette det kontantbeløb, der stilles til rådighed for modparten)	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(A.6.92)	Genkøbsaftalens eller en omvendt genkøbsaftales eksponering (i tilfælde af en omvendt genkøbsaftale er dette det kontantbeløb, der stilles til rådighed for modparten)	(i basisvaluta)
	(A.6.93)	Markedsværdi af den modtagne sikkerhed (i tilknytning til genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale) (det kontantbeløb, som MMF'en har modtaget som led i genkøbsaftaler (jf. artikel 14, litra d), i forordning (EU) 2017/1131))	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(A.6.94)	Markedsværdi af den modtagne sikkerhed (i tilknytning til genkøbsaftalen eller en omvendt genkøbsaftale) (det kontantbeløb, som MMF'en har modtaget som led i genkøbsaftaler (jf. artikel 14, litra d), i forordning (EU) 2017/1131))	(i basisvaluta)
	(A.6.95)	Angiv, om resultatet af den interne kreditvurderingsprocedure er positivt eller negativt (for de forskellige likvide værdipapirer eller (andre) pengemarkedsinstrumenter, der er modtaget som del af en omvendt genkøbsaftale, jf. artikel 15, stk. 6, i forordning (EU) 2017/1131) [6]	(positivt/negativt)

[6] Hvis MMF'en som sikkerhed modtager forskellige aktiver som omhandlet i artikel 15, stk. 6, i forordning (EU) 2017/1131, indberettes resultatet for hvert aktiv.

Punkt	Datatype	Indberettede data
I forbindelse med omvendte genkøbsaftaler og aktiver som omhandlet i artikel 15 i forordning (EU) 2017/1131, der er modtaget af MMF'en, angives følgende:		
(A.6.96)	Disse forskellige aktivers ISIN-kode	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
(A.6.97)	Markedsværdien af de forskellige aktiver	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
(A.6.98)	Markedsværdien af de forskellige aktiver	(i basisvaluta)
(A.6.99)	Angiv, hvis der er tale om omvendte genkøbsaftaler, om MMF'en har modtaget aktiver som omhandlet i artikel 15, stk. 6, i forordning (EU) 2017/1131	(Ja/Nej)
(7) **Oplysninger om MMF'ens passiver**		
a) *Oplysninger om investorerne — investorkoncentration*		
(A.7.1)	Angiv den omtrentlige procentdel af MMF'ens egenkapital, der retmæssigt ejes af de fem ejere, som har de største kapitalinteresser i MMF'en beregnet i procent af MMF'ens nettoaktivværdi. Angiv de endelige, reelle ejere, hvis disse kendes, eller hvis der er mulighed herfor	% (af nettoaktivværdien)
b) *Oplysninger om investorerne — fordeling af investorkoncentration*		
(A.7.2)	Specificér fordelingen af investorkoncentration efter investorernes status (estimat, hvis der ikke foreligger præcise oplysninger): 1) Professionelle kunder (som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 10), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU (7) (MiFID 2)), 2) detailkunder (som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 11), i direktiv 2014/65/EU (MiFID 2))	
	— Professionelle kunder (som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 10), i direktiv 2014/65/EU (MiFID 2)):	% (af nettoaktivværdien)
	— Detailkunder (som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 11), i direktiv 2014/65/EU (MiFID 2)):	% (af nettoaktivværdien)

(7) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af direktiv 2002/92/EF og direktiv 2011/61/EU.

Punkt	Datatype	Indberettede data
c) *Oplysninger om investorerne — geografisk fordeling*		
(A.7.3)	Angiv fordelingen af ejerskabsforholdet for andele/kapitalandele i MMF'en efter investorgruppe. Angiv de endelige, reelle ejere, hvis disse kendes, eller hvis der er mulighed herfor	(% af nettoaktivværdien) Ikke-finansielle selskaber Banker Forsikringsselskaber Andre finansielle institutioner Pensionsordninger/-kasser Offentlig forvaltning og service Andre institutter for kollektiv investering Husholdninger Ukendt
(A.7.4)	Specificér den geografiske fordeling af investorer efter land (estimat, hvis der ikke foreligger præcise oplysninger)	
	Land	(% af nettoaktivværdien, Land — ISO 3166 – 2 tegn)
d) *Oplysninger om investorer — tegnings- og indløsningsaktivitet*		
Investorernes indløsninger		
(A.7.5)	Angiv hyppigheden af investorernes indløsninger. I tilfælde af flere klasser af kapitalandele eller andele angives oplysningerne for den største klasse af kapitalandele/andele efter nettoaktivværdi [Vælg én]	Dagligt Hver uge Hver måned Hver anden måned Andet Ingen indløsningsrettigheder
(A.7.6)	Hvad er investorernes frist i forbindelse med indløsninger, i dage	Dage
(A.7.7)	Hvilken procentdel af MMF'ens nettoaktivværdi er genstand for følgende foranstaltninger pr. indberetningsdatoen:	
	Indløsningsgates	% af nettoaktivværdien

Punkt	Datatype	Indberettede data
	Suspension af handel	% af nettoaktivværdien
	Likviditetsafgifter	% af nettoaktivværdien
	Andre foranstaltninger til forvaltning af illikvide aktiver	Type ordning
		% af nettoaktivværdien
(A.7.8)	MMF'ens nettoaktivværdi i indberetningsperioden	(i EUR, herunder virkningen af tegninger og indløsninger) (på den sidste dag i måneden)
	Januar	
	Februar	
	Marts	
	April	
	Maj	
	Juni	
	Juli	
	August	
	September	
	Oktober	
	November	
	December	
(A.7.9)	Tegninger i indberetningsperioden	(i EUR)
	Januar	
	Februar	
	Marts	
	April	

Punkt		Datatype	Indberettede data
		Maj	
		Juni	
		Juli	
		August	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	
	(A.7.10)	Indløsninger i indberetningsperioden	(i EUR)
		Januar	
		Februar	
		Marts	
		April	
		Maj	
		Juni	
		Juli	
		August	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	

Punkt		Datatype	Indberettede data
	(A.7.11)	Betalinger til investorer	(i EUR)
		Januar	
		Februar	
		Marts	
		April	
		Maj	
		Juni	
		Juli	
		August	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	
	(A.7.12)	Valutakurs	
		Januar	
		Februar	
		Marts	
		April	
		Maj	
		Juni	
		Juli	
		August	

Punkt		Datatype	Indberettede data
		September	
		Oktober	
		November	
		December	

MMF'er med nettoaktivværdi med lav volatilitet

	Punkt	Datatype	Indberettede data
(B) MMF'ER MED NETTOAKTIVVÆRDI MED LAV VOLATILITET			
		a) Angiv alle tilfælde, hvor prisen på et aktiv, der er værdiansat under anvendelse af metoden med opgørelse til amortiseret kostpris, jf. artikel 29, stk. 7, første afsnit, i forordning (EU) 2017/1131, afveg fra prisen på det pågældende aktiv, beregnet i overensstemmelse med artikel 29, stk. 2, 3 og 4, i forordning (EU) 2017/1131, med mere end 10 basispoint. Disse felter indberettes for ethvert aktiv, hvis pris, ved anvendelse af metoden med opgørelse til amortiseret kostpris, ville afvige på en sådan måde	
	(B.1.1)	Værdiansættelsesdato (den første dag, hvor hændelsen indtræffer)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
	(B.1.2)	Aktivets ISIN-kode	ISIN-kode i henhold til ISO 6166 (12-tegns alfanumerisk kode)
	(B.1.3)	Aktivets CFI (hvis en sådan foreligger, og ISIN-koden ikke foreligger)	CFI i henhold til ISO 10692 (bogstavkode bestående af 6 tegn)
	(B.1.4)	Pris (artikel 29, stk. 2, 3 og 4, i forordning (EU) 2017/1131) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.1, hvor hændelsen indtræffer)	
	(B.1.5)	Pris (metoden med opgørelse til amortiseret kostpris) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.1, hvor hændelsen indtræffer)	
	(B.1.6)	Angiv, hvor længe fra værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.1 prisen på et aktiv, der er værdiansat under anvendelse af metoden med opgørelse til amortiseret kostpris, afveg fra prisen på det pågældende aktiv med mere end 10 basispoint	(dage)
	(B.1.7)	Angiv den gennemsnitlige forskel på de to værdier, der er angivet i B.1.6, i den i B.1.6 nævnte periode	

	Punkt	Datatype	Indberettede data
	(B.1.8)	Angiv den mindste prisafvigelse mellem de to værdier i den i B.1.6 nævnte periode	
	(B.1.9)	Angiv den største prisafvigelse mellem de to værdier i den i B.1.6 nævnte periode	
		b) Angiv alle tilfælde, hvor den konstante nettoaktivværdi pr. andel eller kapitalandel beregnet i overensstemmelse med artikel 32, stk. 1 og 2, i forordning (EU) 2017/1131 afveg fra nettoaktivværdien pr. andel eller kapitalandel beregnet i overensstemmelse med artikel 30 i forordning (EU) 2017/1131 med mere end 20 basispoint	
	(B.1.10)	Værdiansættelsesdato (den første dag, hvor hændelsen indtræffer)	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
	(B.1.11)	Konstant nettoaktivværdi (artikel 31 i forordning (EU) 2017/1131) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.10, hvor hændelsen indtræffer)	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(B.1.12)	Konstant nettoaktivværdi (artikel 31 i forordning (EU) 2017/1131) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.10, hvor hændelsen indtræffer)	(i basisvaluta)
	(B.1.13)	Nettoaktivværdi (artikel 30 i forordning (EU) 2017/1131) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.10, hvor hændelsen indtræffer)	(i EUR) (hvis basisvalutaen ikke er EUR, anvendes som vekselkurs den kurs, der senest er fastsat af Den Europæiske Centralbank)
	(B.1.14)	Nettoaktivværdi (artikel 30 i forordning (EU) 2017/1131) (på værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.10, hvor hændelsen indtræffer)	(i basisvaluta)
	(B.1.15)	Angiv, hvor længe fra værdiansættelsesdatoen som angivet i B.1.10 den beregnede konstante nettoaktivværdi pr. andel eller kapitalandel afveg fra nettoaktivværdien pr. andel eller kapitalandel med mere end 20 basispoint	(dage)
	(B.1.16)	Angiv den gennemsnitlige forskel på de to værdier, der er angivet i B.1.15, i den i B.1.15 nævnte periode	
	(B.1.17)	Angiv den mindste prisafvigelse mellem de to værdier i den i B.1.15 nævnte periode	
	(B.1.18)	Angiv den største prisafvigelse mellem de to værdier i den i B.1.15 nævnte periode	
		c) Angiv alle tilfælde, hvor en situation som beskrevet i artikel 34, stk. 3, i forordning (EU) 2017/1131 indtraf, samt de foranstaltninger, der er truffet af bestyrelsen i henhold til samme forordnings artikel 34, stk. 1, litra a) og b)	
	(B.1.19)	Dato for hændelsen	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)

	Punkt	Datatype	Indberettede data
	(B.1.20)	Dato, hvor foranstaltningen blev truffet	Dato i henhold til ISO 8601 (ÅÅÅÅ-MM-DD)
	(B.1.21)	Type foranstaltning (hvis andelen af aktiver med udløb inden for en uge falder til under 30 % af MMF'ens samlede aktiver, og hvis den daglige indløsning på en enkelt arbejdsdag overstiger 10 % af de samlede aktiver)	likviditetsafgifter på indløsningskrav indløsningsgates suspension af indløsninger ingen øjeblikkelige foranstaltninger bortset fra at normalisere forholdene, såfremt de i artikel 24, stk. 1, i forordning (EU) 2017/1131 omhandlede grænser overskrides, jf. samme forordnings artikel 24, stk. 2
	(B.1.22)	Type foranstaltning (hvis andelen af aktiver med udløb inden for en uge falder til under 10 % af dens samlede aktiver)	likviditetsafgifter på indløsningskrav suspension af indløsninger