RÈGLEMENT D'EXÉCUTION (UE) 2018/708 DE LA COMMISSION

du 17 avril 2018

définissant des normes techniques d'exécution en ce qui concerne le modèle à utiliser par les gestionnaires de fonds monétaires pour les rapports aux autorités compétentes prévus à l'article 37 du règlement (UE) 2017/1131 du Parlement européen et du Conseil

(Texte présentant de l'intérêt pour l'EEE)

LA COMMISSION EUROPÉENNE,

vu le traité sur le fonctionnement de l'Union européenne,

vu le règlement (UE) 2017/1131 du Parlement européen et du Conseil du 14 juin 2017 sur les fonds monétaires ([1]), et notamment son article 37, paragraphe 4,

considérant ce qui suit:

(1) En plus des obligations déclaratives prévues par les directives 2009/65/CE ([2]) et 2011/61/UE ([3]) du Parlement européen et du Conseil, de nouvelles exigences de déclaration sont nécessaires pour que les autorités compétentes puissent efficacement détecter et surveiller les risques sur le marché des fonds monétaires, et y réagir.

(2) L'article 37 du règlement (UE) 2017/1131 impose aux fonds monétaires de fournir à leurs autorités compétentes une liste détaillée d'informations. Pour que la manière dont ces autorités recueillent ces données soit harmonisée dans l'ensemble de l'Union européenne et que lesdites autorités soient informées des principales évolutions sur le marché des fonds monétaires et puissent faciliter l'analyse collective des incidences potentielles de ce marché dans l'Union, il faut que les informations leur soient communiquées de manière uniforme dans l'ensemble de l'Union européenne. En outre, l'emploi d'un modèle standard de rapport facilite l'exécution des procédures et processus associés aux obligations de déclaration des fonds monétaires et réduit les coûts connexes.

(3) Afin de garantir une surveillance efficace au sein de l'Union, il faut que ces données soient transmises à l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF), afin qu'une base de données centrale pour les fonds monétaires soit établie.

(4) Le présent règlement se fonde sur les projets de normes techniques d'exécution soumis à la Commission par l'Autorité européenne des marchés financiers (AEMF).

(5) L'AEMF a mené une consultation publique ouverte sur les projets de normes techniques d'exécution sur lesquels se fonde le présent règlement, analysé les coûts et avantages potentiels connexes et sollicité l'avis du groupe des parties intéressées au secteur financier institué par l'article 37 du règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil ([4]).

(6) La date d'application du présent règlement d'exécution devrait être alignée sur la date d'entrée en application du règlement (UE) 2017/1131 afin de permettre aux autorités nationales de collecter les informations à transmettre à la base de données de l'AEMF visée à l'article 37, paragraphe 5, du règlement (UE) 2017/1131,

A ADOPTÉ LE PRÉSENT RÈGLEMENT:

Article premier

Les gestionnaires de fonds monétaires utilisent le modèle figurant à l'annexe du présent règlement lorsqu'ils font rapport à l'autorité compétente pour un fonds monétaire donné en application de l'article 37 du règlement (UE) 2017/1131.

([1]) JO L 169 du 30.6.2017, p. 8.

([2]) Directive 2009/65/CE du Parlement européen et du Conseil du 13 juillet 2009 portant coordination des dispositions législatives, réglementaires et administratives concernant certains organismes de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) (refonte) (JO L 302 du 17.11.2009, p. 32).

([3]) Directive 2011/61/UE du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2011 sur les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs et modifiant les directives 2003/41/CE et 2009/65/CE ainsi que les règlements (CE) n° 1060/2009 et (UE) n° 1095/2010 (JO L 174 du 1.7.2011, p. 1).

([4]) Règlement (UE) n° 1095/2010 du Parlement européen et du Conseil du 24 novembre 2010 instituant une Autorité européenne de surveillance (Autorité européenne des marchés financiers), modifiant la décision n° 716/2009/CE et abrogeant la décision 2009/77/CE de la Commission (JO L 331 du 15.12.2010, p. 84).

Article 2

Le présent règlement entre en vigueur le vingtième jour suivant celui de sa publication au *Journal officiel de l'Union européenne*.

Il est applicable à partir du 21 juillet 2018.

Le présent règlement est obligatoire dans tous ses éléments et directement applicable dans tout État membre.

Fait à Bruxelles, le 17 avril 2018.

Par la Commission

Le président

Jean-Claude JUNCKER

ANNEXE

Modèle de rapport pour les gestionnaires de fonds monétaires

Sauf indication contraire, il convient d'indiquer les chiffres correspondant aux sous-fonds.

Poste	Type de données	Données déclarées
A) APPLICABLE À TOUS LES FONDS MONÉTAIRES		
	(1) **Caractéristiques générales, identification du fonds monétaire et de son gestionnaire**	
(A.1.1)	Période de référence	
(A.1.2)	Code national du fonds monétaire fourni par l'autorité compétente du fonds monétaire	
(A.1.3)	LEI du fonds monétaire	Identifiant d'entité légale ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques (LEI)
(A.1.4)	Code BCE (code d'identification d'IFM) du fonds monétaire	
(A.1.5)	Nom du fonds monétaire	
(A.1.6)	Indiquer si le fonds monétaire est un OPCVM ou un FIA	OPCVM FIA
(A.1.7)	Indiquer si le fonds monétaire est commercialisé uniquement via des régimes d'épargne salariale régis par le droit national et dont les investisseurs sont des personnes physiques (conformément à l'article 16, paragraphe 5, du règlement (UE) 2017/1131 ([1]))	(Oui/Non)
(A.1.8)	Domiciliation du fonds monétaire	ISO 3166 — code pays
(A.1.9)	État membre où le fonds monétaire est agréé	ISO 3166 — code pays
(A.1.10)	États membres où le fonds monétaire est commercialisé	Liste des pays (ISO 3166 — code pays)
(A.1.11)	Date de création du fonds monétaire	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.1.12)	Monnaie de base du fonds monétaire	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques

([1]) Règlement (UE) 2017/1131 du Parlement européen et du Conseil du 14 juin 2017 sur les fonds monétaires

Poste		Type de données	Données déclarées
	(A.1.13)	Code national du gestionnaire du fonds monétaire fourni par l'autorité compétente du fonds monétaire	
	(A.1.14)	Code national du gestionnaire du fonds monétaire fourni par l'autorité compétente du gestionnaire du fonds monétaire	
	(A.1.15)	LEI du gestionnaire du fonds monétaire	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
	(A.1.16)	Code BCE (code d'identification d'IFM) du gestionnaire du fonds monétaire	
	(A.1.17)	Nom du gestionnaire du fonds monétaire	
	(A.1.18)	Pays où le gestionnaire du fonds monétaire est agréé	
	(A.1.19)	LEI du dépositaire du fonds monétaire	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
	(A.1.20)	Code national du dépositaire du fonds monétaire	
	(A.1.21)	Raison sociale du dépositaire du fonds monétaire	
	(2) **Type de fonds monétaire**		
	(A.2.1)	Type de fonds monétaire [Un seul choix possible]	Fonds à VLV court terme Fonds à VLC de dette publique court terme Fonds à VL à faible volatilité court terme Fonds à VLV standard
	(3) **Autres caractéristiques du fonds monétaire**		
	a) *Informations sur le statut maître/nourricier* (fonds monétaire commercialisé uniquement via des régimes d'épargne salariale régis par le droit national et dont les investisseurs sont des personnes physiques)		
	(A.3.1)	Si le fonds monétaire respecte les conditions énoncées à l'article 16, paragraphe 5, du règlement (UE) 2017/1131, indiquer s'il s'agit d'un fonds maître ou d'un fonds nourricier [Un seul choix possible]	Maître Nourricier
	Si le fonds monétaire est un fonds nourricier:		
	(A.3.2)	LEI du fonds maître du fonds monétaire	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques

Poste	Type de données	Données déclarées
(A.3.3)	Code national du fonds maître du fonds monétaire	
(A.3.4)	Raison sociale du fonds maître du fonds monétaire	
b) *Informations sur les catégories d'actions*		
(A.3.5)	Indiquer si le fonds monétaire a des catégories d'actions	(Oui/Non)
(A.3.6)	Si le fonds monétaire a des catégories d'actions, indiquer le code ISIN des différentes catégories d'actions	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.3.7)	Si le fonds monétaire a des catégories d'actions, indiquer la monnaie des différentes catégories d'actions	Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques
c) *Informations sur le fonds précédent ou sur la liquidation (déclaration non récurrente)*		
Si le fonds monétaire a fusionné avec un autre fonds, veuillez indiquer:		
(A.3.8)	Date de la fusion.	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
Si le fonds monétaire fait l'objet d'une liquidation, veuillez indiquer:		
(A.3.9)	Date de la liquidation.	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(4) **Indicateurs propres au portefeuille du fonds monétaire**		
a) *Valeur totale des actifs (aux fins du modèle de rapport au titre du règlement sur les fonds monétaires, la valeur totale des actifs est considérée comme égale à la valeur liquidative — voir ci-dessous le champ A.4.1)*		
b) *Valeur liquidative (au niveau des sous-fonds — pas des catégories d'actions)*		
(A.4.1)	Valeur liquidative du fonds monétaire (niveau sous-fonds)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.4.2)	Valeur liquidative du fonds monétaire	(dans la monnaie de base)
c) *Maturité moyenne pondérée (WAM)*		
(A.4.3)	Maturité moyenne pondérée du fonds monétaire calculée conformément à l'article 2, point 19, du règlement (UE) 2017/1131.	(en jours)

Poste		Type de données	Données déclarées
	d) *Durée de vie moyenne pondérée (WAL)*		
	(A.4.4)	Durée de vie moyenne pondérée du fonds monétaire calculée conformément à l'article 2, point 20, à l'article 24, paragraphe 1, point b), et à l'article 25, paragraphe 1, point b), du règlement (UE) 2017/1131.	(en jours)
	e) *Indicateurs de liquidité*		
	Profil de liquidité du portefeuille		
	(A.4.5)	% des actifs éligibles pour le coussin de liquidité journalière (actifs à échéance journalière tels que définis aux articles 24 et 25 du règlement (UE) 2017/1131)	%
	(A.4.6)	% des actifs éligibles pour le coussin de liquidité hebdomadaire (actifs à échéance hebdomadaire tels que définis aux articles 24 et 25 du règlement (UE) 2017/1131)	%
	(A.4.7)	Profil de liquidité du portefeuille	Pourcentage du portefeuille pouvant être liquidé pour chaque durée
Durée	1 jour ou moins ☐ 2 à 7 jours ☐ 8 à 30 jours ☐ plus de 30 jours ☐		
	f) *Rendement*		
	(A.4.8)	Rendement cumulé	%
Fourchette	Depuis le début de l'année ☐ 1 mois ☐ 3 mois ☐ 1 an ☐ 3 ans ☐ 5 ans ☐		
	(A.4.9)	Performance pour l'année civile (rendement net) de la catégorie d'actions la plus représentative	%
Fourchette	Année N-1 ☐ Année N-2 ☐ Année N-3 ☐		
	(A.4.10)	Volatilité mensuelle de portefeuille et volatilité mensuelle de portefeuille de la valeur liquidative de marché (le cas échéant)	%
Fourchette	1 an ☐ 2 ans ☐ 3 ans ☐		

Poste	Type de données	Données déclarées
(5) **Simulations de crise pour le fonds monétaire**		
a) *Résultats des simulations de crise pour le fonds monétaire*		
(A.5.1)	Les résultats des simulations de crise portant sur la liquidité effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise.	
(A.5.2)	Les résultats des simulations de crise portant sur le risque de crédit effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
(A.5.3)	Les résultats des simulations de crise portant sur les taux de change effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
(A.5.4)	Les résultats des simulations de crise portant sur les taux d'intérêt effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
(A.5.5)	Les résultats des simulations de crise portant sur les niveaux de rachats effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
(A.5.6)	Les résultats des simulations de crise portant sur les écarts entre les indices auxquels les taux d'intérêt des titres du portefeuille sont liés, effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
(A.5.7)	Les résultats des simulations de crise portant sur les chocs macrosystémiques effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	

Poste		Type de données	Données déclarées
	(A.5.8)	Les résultats des simulations de crise multivariables effectuées pour le fonds monétaire au cours de l'exercice, conformément à l'article 28, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131 et les lignes directrices correspondantes de l'AEMF concernant les scénarios des simulations de crise	
	(A.5.9)	Dans le cas de fonds à VLC et de fonds à VL à faible volatilité, indiquer les résultats des simulations de crise mentionnés dans les champs A.5.1 à A.5.8 en termes de différence entre la valeur liquidative constante par part ou par action et la valeur liquidative par part ou par action.	
	b) *Proposition de plan d'action (le cas échéant)*		
	(A.5.10)	Indiquer le plan d'action proposé en application de l'article 28, paragraphe 4, du règlement (UE) 2017/1131	Texte libre
	(6) **Informations sur les actifs détenus dans le portefeuille du fonds monétaire**		
	a) *Instruments du marché monétaire, titrisations éligibles et papiers commerciaux adossés à des actifs (ABCP) éligibles*		
	Les champs A.6 ci-dessous doivent être complétés en utilisant un modèle de rapport ligne par ligne		
	(A.6.1)	Type d'instruments du marché monétaire, de titrisations éligibles ou de papiers commerciaux adossés à des actifs éligibles [plusieurs choix possibles]	
		Indiquer le type d'instruments du marché monétaire, de titrisations éligibles ou de papiers commerciaux adossés à des actifs éligibles	Instruments du marché monétaire visés à l'article 10 du règlement (UE) 2017/1131 Titrisations visées à l'article 13 du règlement délégué (UE) 2015/61 de la Commission ([2]) ABCP visés à l'article 11, paragraphe 1, point b), du règlement (UE) 2017/1131 Une titrisation ou un ABCP simple, transparent et standardisé (STS) visé à l'article 11, paragraphe 1, point c), du règlement (UE) 2017/1131
		Si le type d'actif est un instrument du marché monétaire, remplir les champs A.6.2 à A.6.20	
	(A.6.2)	Description de l'instrument du marché monétaire	
	(A.6.3)	Code ISIN de l'instrument du marché monétaire	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques

([2]) Règlement délégué (UE) 2015/61 de la Commission du 10 octobre 2014 complétant le règlement (UE) nº 575/2013 du Parlement européen et du Conseil en ce qui concerne l'exigence de couverture des besoins de liquidité pour les établissements de crédit (JO L 11 du 17.1.2015, p. 1).

Poste	Type de données	Données déclarées
(A.6.4)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) de l'instrument du marché monétaire	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques
(A.6.5)	LEI de l'émetteur	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
(A.6.6)	Nom de l'émetteur	
(A.6.7)	Catégorie d'émetteur Choisir la catégorie d'émetteur correspondante [Un seul choix possible]	Émetteur souverain (UE) Émetteur souverain (hors UE) Banque centrale de l'Union européenne Banque centrale hors UE Administration régionale Administration locale Organisme public national Organisme public de l'Union européenne (excepté organisme public national) Organisme public hors UE Organisme public supranational (UE) Organisme public supranational (autre que UE) Établissement de crédit Autres sociétés financières Sociétés non financières
(A.6.8)	Pays de l'émetteur de l'instrument du marché monétaire	ISO 3166 — code pays
(A.6.9)	Date d'échéance de l'instrument du marché monétaire	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.6.10)	Monnaie de l'instrument du marché monétaire	(Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques)
(A.6.11)	Quantité de l'instrument du marché monétaire	
(A.6.12)	Prix pied de coupon de l'instrument du marché monétaire	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.13)	Prix pied de coupon de l'instrument du marché monétaire	(dans la monnaie de base)
(A.6.14)	Intérêts échus	

Poste	Type de données	Données déclarées
(A.6.15)	Intérêts échus	(dans la monnaie de base si A.6.14 est en EUR)
(A.6.16)	Valeur de marché totale de l'instrument du marché monétaire	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.17)	Valeur de marché totale de l'instrument du marché monétaire	(dans la monnaie de base)
(A.6.18)	Méthode utilisée pour fixer le prix de l'instrument du marché monétaire	Valorisation au prix du marché Valorisation par référence à un modèle Valorisation selon la méthode du coût amorti
(A.6.19)	Indiquer si le résultat de la procédure d'évaluation interne de la qualité de crédit est positif ou négatif	(positif/négatif)
(A.6.20)	Fournir la prochaine date de mise à jour du taux d'intérêt (telle que mentionnée à l'article 10, paragraphe 2, du règlement (UE) 2017/1131)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
	Si le type d'actif est une titrisation éligible ou un papier commercial adossé à des actifs éligible, compléter les champs A.6.21 à A.6.37	
(A.6.21)	Description de la titrisation éligible ou du papier commercial adossé à des actifs éligible	
(A.6.22)	Code ISIN de la titrisation éligible ou du papier commercial adossé à des actifs éligible	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.23)	Pays du sponsor de la titrisation éligible ou du papier commercial adossé à des actifs éligible	ISO 3166 — code pays
(A.6.24)	LEI du sponsor	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
(A.6.25)	Nom du sponsor	
(A.6.26)	Type de sous-jacent	Créances commerciales Prêts à la consommation Locations ou crédits-bails Créances sur cartes de crédit Prêts à des entreprises ou à des PME Hypothèques sur un bien immobilier résidentiel Hypothèques sur un bien immobilier commercial Autres actifs

Poste		Type de données	Données déclarées
	(A.6.27)	Date d'échéance	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
	(A.6.28)	Monnaie	(Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques)
	(A.6.29)	Quantité	
	(A.6.30)	Prix pied de coupon	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
	(A.6.31)	Prix pied de coupon	(dans la monnaie de base)
	(A.6.32)	Intérêts échus	
	(A.6.33)	Intérêts échus	(dans la monnaie de base si A.6.30 est en EUR)
	(A.6.34)	Valeur de marché totale	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
	(A.6.35)	Valeur de marché totale	(dans la monnaie de base)
	(A.6.36)	Méthode utilisée pour fixer le prix de la titrisation éligible ou du papier commercial adossé à des actifs éligible	Valorisation au prix du marché Valorisation par référence à un modèle Valorisation selon la méthode du coût amorti
	(A.6.37)	Indiquer si le résultat de la procédure d'évaluation interne de la qualité de crédit est positif ou négatif	(positif/négatif)
	b) *Autres actifs*		
	(A.6.38)	Type auquel appartiennent les Autres actifs [un seul choix possible] Le type auquel appartiennent les Autres actifs est à choisir parmi les actifs énumérés à l'article 9 du règlement (UE) 2017/1131	Dépôts auprès d'établissements de crédit tels que visés à l'article 12 du règlement (UE) 2017/1131 Accords de prise en pension tels que visés à l'article 15 du règlement (UE) 2017/1131 Accords de mise en pension tels que visés à l'article 14 du règlement (UE) 2017/1131 Parts ou actions d'autres fonds monétaires telles que visées à l'article 16 du règlement (UE) 2017/1131

Poste	Type de données	Données déclarées
		Instruments financiers dérivés tels que visés à l'article 13 du règlement (UE) 2017/1131, dont: — Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé (préciser s'ils relèvent du point a), du point b) ou du point c) de l'article 50, paragraphe 1, de la directive 2009/65/CE) — Instruments financiers dérivés négociés de gré à gré Actifs liquides détenus à titre accessoire (conformément à l'article 50, paragraphe 2, de la directive 2009/65/CE)
	Si les Autres actifs sont du type Instruments financiers dérivés, remplir les champs A.6.39 à A.6.60	
(A.6.39)	Type de contrat auquel appartient le contrat dérivé	
(A.6.40)	Code ISIN de l'instrument financier dérivé	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.41)	Identifiant unique de produit (IUP) de l'instrument financier dérivé (si le code ISIN n'est pas disponible)	
(A.6.42)	Code FISN (nom abrégé de l'instrument financier) de l'instrument financier dérivé	ISO 18774
(A.6.43)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) de l'instrument financier dérivé	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques.
(A.6.44)	Type d'instrument dérivé visé à l'article 13, point a), du règlement (UE) 2017/1131 [un seul choix possible]	taux d'intérêt devises indices de taux d'intérêt indices de devises
(A.6.45)	Nom du sous-jacent	
(A.6.46)	Type d'identification du sous-jacent ([3])	I = code ISIN X = indice

([3]) Identification du dérivé financier dans le règlement EMIR

Poste	Type de données	Données déclarées
(A.6.47)	Identification du sous-jacent	Pour un identifiant du sous-jacent de type I: Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques Pour un identifiant du sous-jacent de type X: Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques si disponible, sinon nom complet qui a été attribué à l'indice par le fournisseur de l'indice.
(A.6.48)	Monnaie du notionnel 1 ([4])	ISO 4217 Code monnaie
(A.6.49)	Monnaie du notionnel 2 ([5])	ISO 4217 Code monnaie
(A.6.50)	Pays de l'instrument financier dérivé	ISO 3166 — Code pays
(A.6.51)	Date d'échéance de l'instrument financier dérivé	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.6.52)	Exposition de l'instrument financier dérivé	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.53)	Exposition de l'instrument financier dérivé	(dans la monnaie de base)
(A.6.54)	Valeur de marché de l'instrument financier dérivé	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.55)	Valeur de marché de l'instrument financier dérivé	(dans la monnaie de base)
(A.6.56)	Valeur de marché du collatéral reçu (en rapport avec l'instrument financier dérivé)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.57)	Valeur de marché du collatéral reçu (en rapport avec l'instrument financier dérivé)	(dans la monnaie de base)
(A.6.58)	Fournir la prochaine date de mise à jour du taux d'intérêt (telle que mentionnée à l'article 10, paragraphe 2, du règlement (UE) 2017/1131)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.6.59)	Nom de la contrepartie	
(A.6.60)	LEI de la contrepartie	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques

([4]) La monnaie du montant notionnel. Pour les contrats dérivés sur taux d'intérêt, il s'agira de la monnaie notionnelle de la jambe 1.
([5]) La monnaie du montant notionnel. Pour les contrats dérivés sur taux d'intérêt, il s'agira de la monnaie notionnelle de la jambe 2.

Poste	Type de données	Données déclarées
	Si les Autres actifs appartiennent au type Parts ou actions d'autres fonds monétaires, remplir les champs A.6.61 à A.6.71	
(A.6.61)	Description de la part ou action d'autre fonds monétaire	
(A.6.62)	Code ISIN de la part ou action d'autre fonds monétaire	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.63)	Code LEI (si le code ISIN n'est pas disponible) de la part ou action d'autre fonds monétaire	
(A.6.64)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) de la part ou action d'autre fonds monétaire	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques
(A.6.65)	Monnaie	(Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques)
(A.6.66)	Pays de la part ou action d'autre fonds monétaire	ISO 3166 — Code pays
(A.6.67)	Valeur de marché de la part ou action d'autre fonds monétaires	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.68)	Valeur de marché de la part ou action d'autre fonds monétaire	(dans la monnaie de base)
(A.6.69)	Quantité	
(A.6.70)	Prix de la part ou action d'autre fonds monétaire (valeur liquidative par part ou par action)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.71)	Prix de la part ou action d'autre fonds monétaire (valeur liquidative par part ou par action)	(dans la monnaie de base)
	Si les Autres actifs appartiennent aux types Dépôts ou Actifs liquides détenus à titre accessoire, remplir les champs A.6.72 à A.6.81	
(A.6.72)	Description du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	
(A.6.73)	Code ISIN du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.74)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques.
(A.6.75)	Pays du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	ISO 3166 — Code pays

Poste	Type de données	Données déclarées
(A.6.76)	Nom de la contrepartie	
(A.6.77)	LEI de la contrepartie	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
(A.6.78)	Date d'échéance du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.6.79)	Monnaie	(Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques)
(A.6.80)	Exposition du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.81)	Exposition du dépôt ou des actifs liquides détenus à titre accessoire	(dans la monnaie de base)
	Si les Autres actifs appartiennent aux types Accords de mise en pension ou Accords de prise en pension, remplir les champs A.6.82 à A.6.99	
(A.6.82)	Description de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension	
(A.6.83)	Code ISIN de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.84)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques.
(A.6.85)	Pays de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension	ISO 3166 — Code pays
(A.6.86)	Catégorie de contrepartie La catégorie de contrepartie doit être choisie parmi les suivantes (voir article 20, paragraphe 2, point e), du règlement (UE) 2017/1131) [un seul choix possible]	Émetteur souverain (UE) Émetteur souverain (hors UE) Banque centrale de l'Union européenne Banque centrale hors UE Administration régionale Administration locale Organisme public national Organisme public de l'Union européenne (excepté organisme public national) Organisme public hors UE. Organisme public supranational (UE) Organisme public supranational (autre que UE)

Poste	Type de données	Données déclarées
		Établissement de crédit Autres sociétés financières Sociétés non financières
(A.6.87)	LEI de la contrepartie	Code LEI ISO 17442 à 20 caractères alphanumériques
(A.6.88)	Nom de la contrepartie	
(A.6.89)	Date d'échéance de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(A.6.90)	Monnaie	(Code monnaie ISO 4217 à 3 caractères alphabétiques)
(A.6.91)	Exposition de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension (dans le cas d'un accord de prise en pension, il s'agit du montant de liquidités fourni à la contrepartie)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.92)	Exposition de l'accord de mise en pension ou de l'accord de prise en pension (dans le cas d'un accord de prise en pension, il s'agit du montant de liquidités fourni à la contrepartie)	(dans la monnaie de base)
(A.6.93)	Valeur de marché du collatéral reçu (en rapport avec l'accord de mise en pension ou avec l'accord de prise en pension) [le montant des liquidités reçues par le fonds monétaire dans le cadre de l'accord de mise en pension tel que visé à l'article 14, point d), du règlement (UE) 2017/1131]	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.94)	Valeur de marché du collatéral reçu (en rapport avec l'accord de mise en pension ou avec l'accord de prise en pension) [le montant des liquidités reçues par le fonds monétaire dans le cadre de l'accord de mise en pension tel que visé à l'article 14, point d), du règlement (UE) 2017/1131]	(dans la monnaie de base)
(A.6.95)	Indiquer si le résultat de la procédure d'évaluation interne de la qualité de crédit est positif ou négatif (pour les différentes valeurs mobilières liquides ou (autres) instruments du marché monétaire reçus dans le cadre d'un accord de prise en pension tels que visés à l'article 15, paragraphe 6, du règlement (UE) 2017/1131) [6]	(positif/négatif)

[6] Si le fonds monétaire reçoit comme collatéral différents actifs au sens de l'article 15, paragraphe 6, du règlement (UE) 2017/1131, ce résultat doit être indiqué pour chacun des actifs.

Poste	Type de données	Données déclarées
Dans le cas des accords de prise en pension et des actifs visés à l'article 15 du règlement (UE) 2017/1131 qui ont été reçus par le fonds monétaire, veuillez indiquer:		
(A.6.96)	Code ISIN de ces différents actifs	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
(A.6.97)	Valeur de marché de ces différents actifs	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(A.6.98)	Valeur de marché de ces différents actifs	(dans la monnaie de base)
(A.6.99)	Dans le cadre des accords de prise en pension, indiquer si des actifs tels que visés à l'article 15, paragraphe 6, du règlement (UE) 2017/1131 ont été reçus par le fonds monétaire	(Oui/Non)
(7) **Informations sur les passifs du fonds monétaire**		
a) *Informations sur les investisseurs — concentration des investisseurs*		
(A.7.1)	Veuillez donner le pourcentage approximatif du capital du fonds monétaire qui est la propriété effective des cinq bénéficiaires effectifs détenant les plus fortes participations dans le fonds monétaire, en pourcentage de la valeur liquidative du fonds monétaire. Remonter jusqu'aux bénéficiaires effectifs ultimes, dès lors qu'ils sont connus ou que cela est possible.	% (de la valeur liquidative)
b) *Informations sur les investisseurs — répartition de la concentration des investisseurs*		
(A.7.2)	Préciser la répartition de la concentration des investisseurs par type d'investisseurs (en l'absence d'informations précises, fournir une estimation): 1) Clients professionnels [au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 10), de la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil (7) (MiFID 2)], clients de détail [au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 11), de la directive 2014/65/UE (MiFID 2)]	
	— Clients professionnels [au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 10), de la directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil (MiFID 2)]	% (de la valeur liquidative)
	— Clients de détail [au sens de l'article 4, paragraphe 1, point 11), de la directive 2014/65/UE (MiFID 2)]	% (de la valeur liquidative)

(7) Directive 2014/65/UE du Parlement européen et du Conseil du 15 mai 2014 concernant les marchés d'instruments financiers et modifiant la directive 2002/92/CE et la directive 2011/61/UE

Poste	Type de données	Données déclarées
c) *Informations sur les investisseurs — répartition géographique*		
(A.7.3)	Fournir la répartition de la propriété des parts ou actions du fonds monétaire par groupe d'investisseurs. Remonter jusqu'aux bénéficiaires effectifs ultimes, dès lors qu'ils sont connus ou que cela est possible.	(% de la valeur liquidative) Sociétés non financières Banques Sociétés d'assurance Autres établissements financiers Régimes/fonds de pension Administrations publiques Autres organismes de placement collectif Ménages Inconnu
(A.7.4)	Préciser la répartition géographique des investisseurs par pays (en l'absence d'informations précises, fournir une estimation):	
	Pays	(% de la valeur liquidative, Pays - ISO 3166 — 2 caractères)
d) *Information sur les investisseurs — activité de souscription et de rachat*		
Rachats aux investisseurs		
(A.7.5)	Indiquer la fréquence des rachats aux investisseurs. S'il y a plusieurs catégories d'actions ou de parts, indiquer la fréquence pour la catégorie d'actions ou de parts la plus importante d'après la valeur liquidative [un seul choix possible]	Journalière Hebdomadaire Mensuelle Bimensuelle Autre Pas de droits de rachat
(A.7.6)	Quel est le délai de préavis (en jours) à respecter pour les rachats?	Jours
(A.7.7)	À la date de déclaration, quel pourcentage de la valeur liquidative du fonds monétaire fait l'objet des mesures suivantes:	
	Mesures de plafonnement	% de la valeur liquidative

Poste	Type de données	Données déclarées
	Suspension de la négociation	% de la valeur liquidative
	Frais de liquidité	% de la valeur liquidative
	Autres mesures prises pour la gestion des actifs illiquides	Type de mesure
		% de la valeur liquidative
(A.7.8)	Valeur liquidative du fonds monétaire sur la période de référence	(en EUR, après prise en compte de l'impact des souscriptions et rachats) (au dernier jour du mois)
	Janvier	
	Février	
	Mars	
	Avril	
	Mai	
	Juin	
	Juillet	
	Août	
	Septembre	
	Octobre	
	Novembre	
	Décembre	
(A.7.9)	Souscriptions sur la période de déclaration	(en euros)
	Janvier	
	Février	
	Mars	
	Avril	

Poste		Type de données	Données déclarées
		Mai	
		Juin	
		Juillet	
		Août	
		Septembre	
		Octobre	
		Novembre	
		Décembre	
	(A.7.10)	Rachats sur la période de déclaration	(en euros)
		Janvier	
		Février	
		Mars	
		Avril	
		Mai	
		Juin	
		Juillet	
		Août	
		Septembre	
		Octobre	
		Novembre	
		Décembre	

Poste		Type de données	Données déclarées
	(A.7.11)	Versements aux investisseurs	(en euros)
		Janvier	
		Février	
		Mars	
		Avril	
		Mai	
		Juin	
		Juillet	
		Août	
		Septembre	
		Octobre	
		Novembre	
		Décembre	
	(A.7.12)	Taux de change	
		Janvier	
		Février	
		Mars	
		Avril	
		Mai	
		Juin	
		Juillet	
		Août	

Poste		Type de données	Données déclarées
		Septembre	
		Octobre	
		Novembre	
		Décembre	

FONDS À VL À FAIBLE VOLATILITÉ

	Poste	Type de données	Données déclarées
B) APPLICABLE AUX FONDS À VL À FAIBLE VOLATILITÉ			
		a) Indiquer chaque évènement lors duquel le prix d'un actif valorisé selon la méthode du coût amorti conformément à l'article 29, paragraphe 7, premier alinéa, du règlement (UE) 2017/1131 s'écarte de plus de 10 points de base du prix de cet actif calculé conformément à l'article 29, paragraphes 2, 3 et 4, du règlement (UE) 2017/1131. Ces champs doivent être remplis pour chaque actif pour lequel le prix obtenu selon la méthode du coût amorti présente un tel écart.	
	(B.1.1)	Date de valorisation (le premier jour où survient l'évènement)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
	(B.1.2)	Code ISIN de l'actif	Code ISIN ISO 6166 à 12 caractères alphanumériques
	(B.1.3)	Code CFI (si disponible et si le code ISIN n'est pas disponible) de l'actif	Code CFI ISO 10692 à 6 caractères alphabétiques
	(B.1.4)	Prix (article 29, paragraphes 2, 3 et 4, du règlement (UE) 2017/1131) (à la date de valorisation, mentionnée dans le champ B.1.1, à laquelle survient l'évènement)	
	(B.1.5)	Prix (méthode du coût amorti) (à la date de valorisation, mentionnée dans le champ B.1.1, à laquelle survient l'évènement)	
	(B.1.6)	Indiquer combien de temps, à partir de la date de valorisation indiquée dans le champ B.1.1, le prix d'un actif valorisé selon la méthode du coût amorti s'est écarté de plus de 10 points de base du prix de cet actif	(jours)
	(B.1.7)	Indiquer la différence moyenne entre les deux valeurs visées dans le champ B.1.6 pendant la période mentionnée au champ B.1.6	

Poste	Type de données	Données déclarées
(B.1.8)	Indiquer l'écart de prix minimum entre les deux valeurs pendant la période mentionnée au champ B.1.6	
(B.1.9)	Indiquer l'écart de prix maximum entre les deux valeurs pendant la période mentionnée au champ B.1.6	
	b) Indiquer chaque évènement lors duquel la valeur liquidative constante par part ou par action calculée conformément à l'article 32, paragraphes 1 et 2, du règlement (UE) 2017/1131 s'écarte de plus de 20 points de base de la valeur liquidative par part ou par action calculée conformément à l'article 30 du règlement (UE) 2017/1131.	
(B.1.10)	Date de valorisation (le premier jour où survient l'évènement)	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
(B.1.11)	Valeur liquidative constante (article 31 du règlement (UE) 2017/1131) (à la date de valorisation, mentionnée dans le champ B.1.10, à laquelle survient l'évènement)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(B.1.12)	Valeur liquidative constante (article 31 du règlement (UE) 2017/1131) (à la date de valorisation, mentionnée dans le champ B.1.10, à laquelle survient l'évènement)	(dans la monnaie de base)
(B.1.13)	Valeur liquidative (article 30 du règlement (UE) 2017/1131) (à la date de valorisation mentionnée dans le champ B.1.10, à laquelle survient l'évènement)	(en EUR) (si la monnaie de base n'est pas l'EUR, le taux de change à utiliser est le dernier taux établi par la Banque centrale européenne)
(B.1.14)	Valeur liquidative (article 30 du règlement (UE) 2017/1131) (à la date de valorisation, mentionnée dans le champ B.1.10, à laquelle survient l'évènement)	(dans la monnaie de base)
(B.1.15)	Indiquer combien de temps, à partir de la date de valorisation indiquée dans le champ B.1.10, la valeur liquidative constante par part ou par action calculée s'est écartée de plus de 20 points de base de la valeur liquidative par part ou par action calculée.	(jours)
(B.1.16)	Indiquer la différence moyenne entre les deux valeurs visées dans le champ B.1.15 pendant la période mentionnée au champ B.1.15	
(B.1.17)	Indiquer l'écart de prix minimum entre les deux valeurs pendant la période mentionnée au champ B.1.15	
(B.1.18)	Indiquer l'écart de prix maximum entre les deux valeurs pendant la période mentionnée au champ B.1.15	
	c) Indiquer chaque évènement lors duquel une situation mentionnée à l'article 34, paragraphe 3, du règlement (UE) 2017/1131 survient, ainsi que les mesures prises par le conseil d'administration conformément à l'article 34, paragraphe 1, points a) et b) dudit règlement.	
(B.1.19)	Date à laquelle l'évènement survient	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)

	Poste	Type de données	Données déclarées
	(B.1.20)	Date à laquelle la mesure a été prise	Date au format ISO 8601 (AAAA-MM-JJ)
	(B.1.21)	Type de mesure (si la proportion des actifs à échéance hebdomadaire tombe en dessous de 30 % des actifs totaux du fonds monétaire et si les rachats journaliers nets sur un jour ouvrable donné dépassent 10 % du total des actifs)	application de frais de liquidité aux rachats mesures de plafonnement des rachats suspension des rachats pas de mesure immédiate si ce n'est régulariser la situation de dépassement des limites fixées à l'article 24, paragraphe 1, du règlement (UE) 2017/1131, conformément à l'article 24, paragraphe 2, dudit règlement
	(B.1.22)	Type de mesure (si la proportion des actifs à échéance hebdomadaire tombe en dessous de 10 % des actifs totaux du fonds)	application de frais de liquidité aux rachats suspension des rachats