UITVOERINGSVERORDENING (EU) 2018/708 VAN DE COMMISSIE

van 17 april 2018

tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen wat betreft de ten behoeve van de rapportage aan bevoegde autoriteiten overeenkomstig artikel 37 van Verordening (EU) 2017/1131 van het Europees Parlement en de Raad door beheerders van geldmarktfondsen te gebruiken template

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) 2017/1131 van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2017 inzake geldmarktfondsen ([1]), en met name artikel 37, lid 4,

Overwegende hetgeen volgt:

(1) Naast de krachtens Richtlijn 2009/65/EG ([2]) en Richtlijn 2011/61/EU ([3]) van het Europees Parlement en de Raad vastgestelde rapportageverplichtingen zijn verdere rapportageverplichtingen vereist om ervoor te zorgen dat de bevoegde autoriteiten de risico's op de markt voor geldmarktfondsen (hierna „MMF's" genoemd) op te sporen, te monitoren en daarop te reageren.

(2) Krachtens artikel 37 van Verordening (EU) 2017/1131 moeten MMF's hun bevoegde autoriteiten een gedetailleerde lijst met gegevens verstrekken. Met het oog op consistentie in de hele Unie wat betreft de wijze waarop deze autoriteiten die gegevens verzamelen, en om ervoor te zorgen dat genoemde autoriteiten op de hoogte zijn van de voornaamste ontwikkelingen op de MMF-markt en aan een collectieve analyse van de mogelijke gevolgen voor de MMF-markt in de Unie kunnen bijdragen, dienen deze gegevens in de hele Unie op eenvormige wijze aan de bevoegde autoriteiten te worden verstrekt. Bovendien maakt het gebruik van een standaardtemplate voor rapportage het eenvoudiger om de procedures en processen met betrekking tot de rapportagevereisten voor MFF te doorlopen, en worden daarmee de daaraan verbonden kosten zo veel mogelijk beperkt.

(3) Met het oog op een effectief toezicht binnen de Unie dienen dergelijke gegevens te worden doorgeleid naar de Europese Autoriteit voor effecten en markten (ESMA), zodat een centrale databank van MMF's kan worden gecreëerd.

(4) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen die ESMA aan de Commissie heeft voorgelegd.

(5) ESMA heeft een open publieke consultatie gehouden over de ontwerpen van technische uitvoeringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, de eventuele daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd en de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad ([4]) opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht.

(6) De toepassingsdatum van deze uitvoeringsverordening dient te worden afgestemd op de datum waarop Verordening (EU) 2017/1131 van kracht wordt, zodat de nationale autoriteiten de gegevens kunnen verzamelen die moeten worden doorgeleid naar de in artikel 37, lid 5, van Verordening (EU) 2017/1131 genoemde databank,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Beheerders van geldmarktfondsen (MMF's) gebruiken de template in de bijlage bij deze verordening om aan de bevoegde autoriteit van een bepaalde MMF te rapporteren in overeenstemming met artikel 37 van Verordening (EU) 2017/1131 van het Europees Parlement en de Raad.

([1]) PB L 169 van 30.6.2017, blz. 8.

([2]) Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement en de Raad van 13 juli 2009 tot coördinatie van de wettelijke en bestuursrechtelijke bepalingen betreffende bepaalde instellingen voor collectieve belegging in effecten (icbe's) (herschikking) (PB L 302 van 17.11.2009, blz. 32).

([3]) Richtlijn 2011/61/EU van het Europees Parlement en de Raad van 8 juni 2011 inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen en tot wijziging van de Richtlijnen 2003/41/EG en 2009/65/EG en van de Verordeningen (EG) nr. 1060/2009 en (EU) nr. 1095/2010 (PB L 174 van 1.7.2011, blz. 1).

([4]) Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

Artikel 2

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Zij is van toepassing vanaf 21 juli 2018.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 17 april 2018.

Voor de Commissie

De voorzitter

Jean-Claude JUNCKER

BIJLAGE

Rapportagetemplate voor beheerders van geldmarktfondsen (MMF's)

Tenzij anders aangegeven moet u alle cijfers invullen op subfondsniveau.

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
A) VAN TOEPASSING OP ALLE MMF'S		
	(1) **Algemene kenmerken, identificatie van het MMF en de beheerder van dat MMF**	
(A.1.1)	Rapportageperiode	
(A.1.2)	Nationale code MMF zoals die door de voor het MMF bevoegde autoriteit is gegeven	
(A.1.3)	LEI van het MMF	Identificatiecode voor juridische entiteiten (Legal Entity Identifier — LEI) volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
(A.1.4)	ECB-code (MFI ID-code) van het MMF	
(A.1.5)	Naam MMF	
(A.1.6)	Is het MMF een icbe of een abi?	Icbe Abi
(A.1.7)	Wordt het MMF alleen verhandeld middels spaarregelingen van werknemers onder nationaal recht en die uitsluitend natuurlijke personen als beleggers hebben (in overeenstemming met artikel 16, lid 5, van Verordening (EU) 2017/1131 ([1]))?	(Ja/Neen)
(A.1.8)	Domicilie van de abi	ISO 3166 — Landcode
(A.1.9)	Lidstaat waar het MMF een vergunning heeft	ISO 3166 — Landcode
(A.1.10)	Lidstaten waar het MMF wordt verhandeld	Landenlijst (ISO 3166 — Landcode)
(A.1.11)	Startdatum MMF	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
(A.1.12)	Basisvaluta MMF	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)

([1]) Verordening (EU) 2017/1131 van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2017 inzake geldmarktfondsen.

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
(A.1.13)	Nationale code van de beheerder van het MMF zoals die door de voor het MMF bevoegde autoriteit is gegeven	
(A.1.14)	Nationale code van de beheerder van het MMF zoals die door de voor de beheerder van het MMF bevoegde autoriteit is gegeven	
(A.1.15)	LEI beheerder MMF	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
(A.1.16)	ECB-code (MFI ID-code) van de beheerder van het MMF	
(A.1.17)	Naam beheerder MMF	
(A.1.18)	Land waar de beheerder van het MMF een vergunning heeft	
(A.1.19)	LEI van bewaarder MMF	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
(A.1.20)	Nationale code bewaarder MMF	
(A.1.21)	Juridische naam bewaarder MMF	
(2) **Type MMF**		
(A.2.1)	MMF-type [Selecteer één type]	Kortlopende VNAV MMF Kortlopende overheidsschuld-CNAV MMF Kortlopende LVNAV MMF Standaard VNAV MMF
(3) **Andere kenmerken van het MMF**		
a) *Master-/feeder-informatie* (het MMF wordt alleen verhandeld middels een spaarregeling van werknemers onder nationaal recht en heeft uitsluitend natuurlijke personen als beleggers)		
(A.3.1)	Voldoet het MMF aan de voorwaarden van artikel 16, lid 5, van Verordening (EU) 2017/1131, geef dan aan of het MMF een master- of een feederfonds is. [Selecteer één van beide]	Master Feeder
Indien het MMF een feeder is:		
(A.3.2)	LEI master MMF	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(A.3.3)	Nationale code master MMF	
	(A.3.4)	Juridische naam master MMF	
	b) *Informatie over aandelenklassen*		
	(A.3.5)	Heeft het MMF aandelenklassen?	(Ja/Neen)
	(A.3.6)	Wanneer het MMF aandelenklassen heeft, geef dan het individuele ISIN van de verschillende aandelenklassen.	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
	(A.3.7)	Wanneer het MMF aandelenklassen heeft, geef dan de valuta van de verschillende aandelenklassen.	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	c) *Informatie over voorafgaand fonds of liquidatie (eenmalige rapportage)*		
	Is het MMF gefuseerd met een ander fonds, geef dan:		
	(A.3.8)	Datum fusie	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	Wordt het MMF geliquideerd, geef dan:		
	(A.3.9)	Datum liquidatie	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(4) **Portefeuille-indicatoren MMF**		
	a) *Totale waarde activa (voor de rapportagetemplate van de MMF-verordening geldt dat de totale waarde van activa gelijk is aan de NAV — zie verder veld A.4.1)*		
	b) *NAV (subfondsniveau — geen aandelenklasse)*		
	(A.4.1)	Intrinsieke waarde (NAV) MMF (subfondsniveau)	(EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.4.2)	Intrinsieke waarde (NAV) MMF	(in basisvaluta)
	c) *WAM*		
	(A.4.3)	Gewogen gemiddelde looptijd (WAM) van het MMF, berekend overeenkomstig artikel 2, punt 19, van Verordening (EU) 2017/1131	(in dagen)

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	d) *WAL*		
	(A.4.4)	Gewogen gemiddelde duur (WAL) van het MMF, berekend overeenkomstig artikel 2, punt 20, artikel 24, lid 1, onder b), en artikel 25, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/1131	(in dagen)
	e) *Liquiditeitsindicatoren*		
	Liquiditeitsprofiel van de portefeuille		
	(A.4.5)	% activa dat in aanmerking komt voor de dagelijkse liquiditeitsbuffer (dagelijks vervallende activa in de zin van de artikelen 24 en 25 van Verordening (EU) 2017/1131)	%
	(A.4.6)	% activa dat in aanmerking komt voor de wekelijkse liquiditeitsbuffer (wekelijks vervallende activa in de zin van de artikelen 24 en 25 van Verordening (EU) 2017/1131)	%
	(A.4.7)	Liquiditeitsprofiel portefeuille	Percentage van de portefeuille dat binnen de volgende periode liquide kan worden gemaakt
Periode	één dag of minder ☐ 2-zeven dagen ☐ 8-30 dagen ☐ meer dan 30 dagen ☐		
	f) *Rendement*		
	(A.4.8)	Gecumuleerd rendement	%
Bereik	YTD ☐ één maand ☐ drie maanden ☐ één jaar ☐ 3 jaar ☐ 5 jaar ☐		
	(A.4.9)	Prestatie (nettorendement) over een kalenderjaar van de meest representatieve aandelenklasse	%
Bereik	Jaar N-1 ☐ Jaar N-2 ☐ Jaar N-3 ☐		
	(A.4.10)	Maandelijkse portefeuillevolatiliteit en maandelijkse portefeuillevolatiliteit van de schaduw-NAV (voor zover van toepassing)	%
Bereik	één jaar ☐ 2 jaar ☐ 3 jaar ☐		

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
(5) **Stresstests van het MMF**		
a) *Resultaten van de stresstests van het MMF*		
(A.5.1)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor liquiditeit, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.2)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor kredietrisico, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.3)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor wisselkoersrisico, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.4)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor renterisico, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.5)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor terugbetalingsniveaus, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.6)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor de spread tussen indexen waarmee de rentevoeten van effecten in portefeuille samenhangen, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
(A.5.7)	Resultaten van de stresstest van het MMF voor macrosysteemschokken, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(A.5.8)	Resultaten van de multivariate stresstest van het MMF voor macrosysteemschokken, uitgevoerd in de rapportageperiode, als beschreven in artikel 28, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 en de desbetreffende ESMA-richtsnoeren voor stresstestscenario's	
	(A.5.9)	In het geval van overheidsschuld-CNAV MMF's en LVNAV MMF's geeft u de resultaten van de stresstests in de velden A.5.1 t/m A.5.8 in termen van verschil tussen de constante NAV per recht van deelneming of aandeel en de NAV per recht van deelneming of aandeel.	
	b) *Voorstel voor een actieplan (indien van toepassing)*		
	(A.5.10)	Geef het voorgestelde actieplan als beschreven in artikel 28, lid 4, van Verordening (EU) 2017/1131	Vrije tekst
	(6) **Informatie over de activa in de portefeuille van het MMF**		
	a) *Geldmarktinstrumenten, in aanmerking komende securitisaties en door activa gedekt commercial paper (ABCP's)*		
	Om de velden in de onderstaande rubriek A.6 in te vullen, gebruikt u een post-voor-post rapportagetemplate.		
	(A.6.1)	Soort geldmarktinstrument, in aanmerking komende securitisaties en door activa gedekt commercial paper (ABCP's) [Selecteer één of meer soorten]	
		Geef het soort geldmarktinstrumenten, in aanmerking komende securitisaties en door activa gedekt commercial paper (ABCP's).	Geldmarktinstrumenten overeenkomstig artikel 10 van Verordening (EU) 2017/1131 Securitisaties als bedoeld in artikel 13 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2015/61 van de Commissie ([2]) ABCP's als bedoeld in artikel 11, lid 1, punt b), van Verordening (EU) 2017/1131 Een eenvoudige, transparante en gestandaardiseerde (STS) securitisatie of ABCP als bedoeld in artikel 11, lid 1, punt c), van Verordening (EU) 2017/1131
		Is het type activa een geldmarktinstrument, vul dan de velden A.6.2 t/m A.6.20 in.	
	(A.6.2)	Beschrijving van de activa van het geldmarktinstrument	
	(A.6.3)	ISIN geldmarktinstrument	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)

([2]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2015/61 van 10 oktober 2014 tot aanvulling van Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot het liquiditeitsdekkingsvereiste voor kredietinstellingen (PB L 11 van 17.1.2015, blz. 1).

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
(A.6.4)	CFI (indien beschikbaar, en indien ISIN niet beschikbaar is) van het geldmarktinstrument	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
(A.6.5)	LEI uitgevende instantie	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
(A.6.6)	Naam uitgevende instantie	
(A.6.7)	Categorie uitgevende instantie De categorieën uitgevende instanties selecteert u de uit desbetreffende instanties. [Selecteer één instantie]	Overheid (EU) Overheid (niet-EU) EU centrale bank Niet-EU centrale bank Regionaal Lokaal Nationale overheidsinstantie EU-overheidsinstantie (niet zijnde nationale overheidsinstantie) Niet-EU-overheidsinstantie Supranationale overheidsinstantie (EU) Supranationale overheidsinstantie (niet-EU) Kredietinstelling Andere financiële vennootschappen Niet-financiële vennootschappen
(A.6.8)	Land uitgevende instantie geldmarktinstrument	ISO 3166 — Landcode
(A.6.9)	Vervaldag geldmarktinstrument	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
(A.6.10)	Valuta geldmarktinstrument	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
(A.6.11)	Aantal geldmarktinstrumenten	
(A.6.12)	Clean price geldmarktinstrument	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.13)	Clean price geldmarktinstrument	(in basisvaluta)
(A.6.14)	Opgelopen rente	

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
(A.6.15)	Opgelopen rente	(in basisvaluta, indien A.6.14 in EUR luidt)
(A.6.16)	Totale marktwaarde geldmarktinstrument	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.17)	Totale marktwaarde geldmarktinstrument	(in basisvaluta)
(A.6.18)	Methode gebruikt om het geldmarktinstrument te beprijzen	Marktwaarde Modellenbenadering Geamortiseerde kostprijs
(A.6.19)	Is de uitkomst van de interne kredietkwaliteitsbeoordelingsprocedure gunstig of ongunstig?	(gunstig/ongunstig)
(A.6.20)	Geef de datum van de volgende aanpassing van de rentevoet (als vermeld in artikel 10, lid 2, van Verordening (EU) 2017/1131).	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	Is het type activa een in aanmerking komende securitisatie of een door activa gedekt commercial paper (ABCP), vul dan de velden A.6.21 t/m A.6.37 in.	
(A.6.21)	Beschrijving van de activa van de in aanmerking komende securitisatie of ABCP	
(A.6.22)	ISN in aanmerking komende securitisatie of ABCP	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
(A.6.23)	Land sponsor in aanmerking komende securitisatie en ABCP	ISO 3166 — Landcode
(A.6.24)	LEI sponsor	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
(A.6.25)	Naam sponsor	
(A.6.26)	Type onderliggende waarde	Handelsvorderingen Consumptief krediet Leasing Kredietkaartvorderingen Leningen aan ondernemingen of kmo's Hypotheekleningen op niet-zakelijk onroerend goed Hypotheekleningen op zakelijk onroerend goed Overige activa

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(A.6.27)	Vervaldatum	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(A.6.28)	Valuta	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	(A.6.29)	Aantal	
	(A.6.30)	Clean price	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.6.31)	Clean price	(in basisvaluta)
	(A.6.32)	Opgelopen rente	
	(A.6.33)	Opgelopen rente	(in basisvaluta, indien A.6.30 in EUR luidt)
	(A.6.34)	Totale marktwaarde	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.6.35)	Totale marktwaarde	(in basisvaluta)
	(A.6.36)	Methode gebruikt om de in aanmerking komende securitisaties of ABCP's te beprijzen	Marktwaarde Modellenbenadering Geamortiseerde kostprijs
	(A.6.37)	Is de uitkomst van de interne kredietkwaliteitsbeoordelingsprocedure gunstig of ongunstig?	(gunstig/ongunstig)
	b) *Overige activa*		
	(A.6.38)	Soort overige activa [Selecteer één soort] Het soort overige activa selecteert u uit de activa vermeld in artikel 9 van Verordening (EU) 2017/1131.	Deposito's bij kredietinstellingen als bedoeld in artikel 12 van Verordening (EU) 2017/1131 Omgekeerde retrocessieovereenkomsten als bedoeld in artikel 15 van Verordening (EU) 2017/1131 Retrocessieovereenkomsten als bedoeld in artikel 14 van Verordening (EU) 2017/1131 Rechten van deelneming in of aandelen van andere MMF's als bedoeld in artikel 16 van Verordening (EU) 2017/1131

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
			Financiële derivaten als bedoeld in artikel 13 van Verordening (EU) 2017/1131, waarvan: — op een gereglementeerde markt verhandelde financiële derivaten (geef ook aan of deze valt onder artikel 50, lid 1, onder a), b) of c), van Richtlijn 2009/65/EG) — over the counter (otc) verhandelde financiële derivaten Accessoir gehouden liquide middelen (overeenkomstig artikel 50, lid 2, van Richtlijn 2009/65/EG)
		Is het type overige activa een financieel derivaat, vul dan de velden A.6.39 t/m A.6.60 in.	
	(A.6.39)	Soort derivatencontract	
	(A.6.40)	ISIN financieel derivaat	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
	(A.6.41)	UPI financieel derivaat (indien ISIN niet beschikbaar is)	
	(A.6.42)	FISN (Financial Instrument Short Name) financieel derivaat	ISO 18774
	(A.6.43)	CFI financieel derivaat (indien beschikbaar, en indien ISIN niet beschikbaar is)	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
	(A.6.44)	Soort derivaat als beschreven in artikel 13, punt a), van Verordening (EU) 2017/1131 [selecteer één item]	Rente Valuta Rente-indexen Valuta-indexen
	(A.6.45)	Naam onderliggende waarde	
	(A.6.46)	Identificatie type onderliggende waarde ([3])	I = ISIN X = Index

([3]) Identificatie financieel derivaat in EMIR.

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
(A.6.47)	Identificatie onderliggende waarde	Voor identificatie onderliggende waarde type I: ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens) Voor identificatie onderliggende waarde type X: ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens), voor zover beschikbaar; anders volledige naam index zoals toegekend door aanbieder index
(A.6.48)	Nominale valuta 1 ([4])	ISO 4217 — Valutacode
(A.6.49)	Nominale valuta 2 ([5])	ISO 4217 — Valutacode
(A.6.50)	Land financieel derivaat	ISO 3166 — Landcode
(A.6.51)	Vervaldag financieel derivaat	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
(A.6.52)	Blootstelling financieel derivaat	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.53)	Blootstelling financieel derivaat	(in basisvaluta)
(A.6.54)	Marktwaarde financieel derivaat	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.55)	Marktwaarde financieel derivaat	(in basisvaluta)
(A.6.56)	Marktwaarde ontvangen zekerheden (m.b.t. het financiële derivaat)	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.57)	Marktwaarde ontvangen zekerheden (m.b.t. het financiële derivaat)	(in basisvaluta)
(A.6.58)	Geef de datum van de volgende aanpassing van de rentevoet (als vermeld in artikel 10, lid 2, van Verordening (EU) 2017/1131).	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
(A.6.59)	Naam tegenpartij	
(A.6.60)	LEI tegenpartij	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)

([4]) De valuta van het nominale bedrag. Bij een contract met betrekking tot een rentederivaat is dit de valuta van deel 1.
([5]) De valuta van het nominale bedrag. Bij een contract met betrekking tot een rentederivaat is dit de valuta van deel 2.

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	Is het type overige activa een recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's, vul dan de velden A.6.61 t/m A.6.71 in.	
(A.6.61)	Beschrijving activa van recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's	
(A.6.62)	ISIN recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
(A.6.63)	LEI recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's (indien ISIN niet beschikbaar is)	
(A.6.64)	CFI-code recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's (indien beschikbaar en indien ISIN niet beschikbaar is)	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
(A.6.65)	Valuta	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
(A.6.66)	Land recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's	ISO 3166 — Landcode
(A.6.67)	Marktwaarde recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.68)	Marktwaarde recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's	(in basisvaluta)
(A.6.69)	Aantal	
(A.6.70)	Prijs recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's (NAV per recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's)	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.71)	Prijs recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's (NAV per recht van deelneming in of aandeel van andere MMF's)	(in basisvaluta)
	Is het type overige activa een deposito of accessoir gehouden liquide middelen, vul dan de velden A.6.72 t/m A.6.81 in.	
(A.6.72)	Beschrijving activa van deposito of accessoir gehouden liquide middelen	
(A.6.73)	ISIN deposito of accessoir gehouden liquide middelen	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
(A.6.74)	CFI deposito of accessoir gehouden liquide middelen (indien beschikbaar, en indien ISIN niet beschikbaar is)	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
(A.6.75)	Land deposito of accessoir gehouden liquide middelen	ISO 3166 — Landcode

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(A.6.76)	Naam tegenpartij	
	(A.6.77)	LEI tegenpartij	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
	(A.6.78)	Vervaldatum deposito of accessoir gehouden liquide middelen	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(A.6.79)	Valuta	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	(A.6.80)	Blootstelling deposito of accessoir gehouden liquide middelen	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.6.81)	Blootstelling deposito of accessoir gehouden liquide middelen	(in basisvaluta)
		Is het type overige activa een retrocessieovereenkomst of een omgekeerde retrocessieovereenkomst, vul dan de velden A.6.82 t/m A.6.99 in.	
	(A.6.82)	Beschrijving activa retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst	
	(A.6.83)	ISIN activa retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
	(A.6.84)	CFI retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst (indien beschikbaar, en indien ISIN niet beschikbaar is)	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
	(A.6.85)	Land retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst	ISO 3166 — Landcode
	(A.6.86)	Categorie tegenpartij Selecteer de categorie tegenpartij uit een van de volgende (zie artikel 20, lid 2, onder e), van Verordening (EU) 2017/1131). [Selecteer één categorie]	Overheid (EU) Overheid (niet-EU) EU centrale bank Niet-EU centrale bank Regionaal Lokaal Nationale overheidsinstantie EU-overheidsinstantie (niet zijnde nationale overheidsinstantie) Niet-EU overheidsinstantie Supranationale overheidsinstantie (EU) Supranationale overheidsinstantie (niet-EU)

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
			Kredietinstelling Andere financiële vennootschappen Niet-financiële vennootschappen
	(A.6.87)	LEI tegenpartij	LEI volgens ISO 17442 (20 alfanumerieke tekens)
	(A.6.88)	Naam tegenpartij	
	(A.6.89)	Vervaldatum retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(A.6.90)	Valuta	Valutacode volgens ISO 4217 (3 alfabetische tekens)
	(A.6.91)	Blootstelling retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst (in het geval van een omgekeerde retrocessieovereenkomst is dit het bedrag aan geldmiddelen dat aan de tegenpartij is verstrekt)	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.6.92)	Blootstelling retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst (in het geval van een omgekeerde retrocessieovereenkomst is dit het bedrag aan geldmiddelen dat aan de tegenpartij is verstrekt)	(in basisvaluta)
	(A.6.93)	Marktwaarde ontvangen zekerheid (m.b.t. retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst) (het bedrag aan geldmiddelen dat het MMF heeft ontvangen in het kader van retrocessieovereenkomsten (als bedoeld in artikel 14, punt d), van Verordening (EU) 2017/1131))	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(A.6.94)	Marktwaarde ontvangen zekerheid (m.b.t. retrocessieovereenkomst of omgekeerde retrocessieovereenkomst) (het bedrag aan geldmiddelen dat het MMF heeft ontvangen in het kader van retrocessieovereenkomsten (als bedoeld in artikel 14, punt d), van Verordening (EU) 2017/1131))	(in basisvaluta)
	(A.6.95)	Is de uitkomst van de interne kredietkwaliteitsbeoordelingsprocedure gunstig of ongunstig? (voor de verschillende liquide effecten of (andere) geldmarktinstrumenten ontvangen in het kader van een omgekeerde retrocessieovereenkomst als bedoeld in artikel 15, lid 6, van Verordening (EU) 2017/1131) [6]	(gunstig/ongunstig)

[6] Indien het MMF als zekerheid verschillende activa in de zin van artikel 15, lid 6, van Verordening (EU) 2017/1131 ontvangt, dient de uitkomst voor elk activum te worden gerapporteerd.

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
Geef met betrekking tot de omgekeerde retrocessieovereenkomsten en activa als bedoeld in artikel 15 van Verordening (EU) 2017/1131 die door het MMF zijn ontvangen:		
(A.6.96)	ISIN van deze verschillende activa	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
(A.6.97)	Marktwaarde van deze verschillende activa	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
(A.6.98)	Marktwaarde van deze verschillende activa	(in basisvaluta)
(A.6.99)	Wat betreft omgekeerde retrocessieovereenkomsten, zijn er activa als bedoeld in artikel 15, lid 6, van Verordening (EU) 2017/1131 door het MMF ontvangen?	(Ja/Neen)
(7) **Informatie over de passiva van het MMF**		
a) *Informatie over de beleggers — Beleggersconcentratie*		
(A.7.1)	Geef het benaderende percentage van het eigen vermogen van het MMF waarvan de vijf economische eigenaren met het grootste aandelenbelang in het MMF de economische eigendom genieten (als percentage van de NAV van het MMF). Doorkijk naar de ultimate beneficial owners (voor zover bekend of mogelijk)	% (van NAV)
b) *Informatie over de beleggers — Uitsplitsing beleggersconcentratie*		
(A.7.2)	Geef de uitsplitsing van de beleggersconcentratie volgens de status van de beleggers (geef een raming als geen precieze informatie beschikbaar is): 1) Professionele cliënten (in de zin van artikel 4, lid 1, punt 10, van Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad (7) (MiFID 2), en 2) niet-professionele cliënten (in de zin van artikel 4, lid 1, punt 11, van Richtlijn 2014/65/EU (MiFID 2)	
	— Professionele cliënten (in de zin van artikel 4, lid 1, punt 10, van Richtlijn 2014/65/EU (MiFID 2))	% (van NAV)
	— Niet-professionele cliënten (in de zin van artikel 4, lid 1, punt 11, van Richtlijn 2014/65/EU (MiFID 2))	% (van NAV)

(7) Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten voor financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU

Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
c) *Informatie over de beleggers — Geografische uitsplitsing*		
(A.7.3)	Geef de eigendom van rechten van deelneming/aandelen in het MMF uitgesplitst naar categorie beleggers. Doorkijk naar de ultimate beneficial owners (voor zover bekend of mogelijk)	(% van NAV) Niet-financiële vennootschappen Banken Verzekeringsinstellingen Overige financiële vennootschappen Pensioenplannen/-fondsen Overheid Andere instellingen voor collectieve belegging Huishoudens Onbekend
(A.7.4)	Geef de geografische uitsplitsing van de beleggers naar land (geef een raming als geen precieze informatie beschikbaar is):	
	Land	(% van NAV, Landen — ISO 3166 — 2 tekens)
d) *Informatie over beleggers — Inschrijving en terugbetaling*		
Terugbetalingen aan beleggers		
(A.7.5)	Hoe vaak hebben terugbetalingen aan beleggers plaatsgevonden? In het geval van meerdere klassen aandelen of rechten van deelneming rapporteert u de grootste klasse aandelen of rechten van deelneming naar NAV. [Selecteer één frequentie]	Dagelijks Wekelijks Maandelijks Tweemaandelijks Overige Geen terugbetalingsrechten
(A.7.6)	Wat is (in dagen) de opzeggingstermijn voor terugbetalingen?	Dagen
(A.7.7)	Welk percentage van de NAV van de MMF's valt op de rapportagedatum onder de volgende regelingen?	
	Beperkingen	% van NAV

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
		Opschorting van de handel	% van NAV
		Liquiditeitsvergoedingen	% van NAV
		Andere regelingen voor het beheer van illiquide activa	Soort regeling
			% van NAV
	(A.7.8)	Intrinsieke waarde (NAV) MMF tijdens de rapportageperiode	(in EUR, met inbegrip van de impact van inschrijvingen en terugbetalingen) (op de laatste dag van de maand)
		Januari	
		Februari	
		Maart	
		April	
		Mei	
		Juni	
		Juli	
		Augustus	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	
	(A.7.9)	Inschrijvingen tijdens de rapportageperiode	(in EUR)
		Januari	
		Februari	
		Maart	
		April	

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
		Mei	
		Juni	
		Juli	
		Augustus	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	
	(A.7.10)	Terugbetalingen tijdens de rapportageperiode	(in EUR)
		Januari	
		Februari	
		Maart	
		April	
		Mei	
		Juni	
		Juli	
		Augustus	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(A.7.11)	Betalingen aan beleggers	(in EUR)
		Januari	
		Februari	
		Maart	
		April	
		Mei	
		Juni	
		Juli	
		Augustus	
		September	
		Oktober	
		November	
		December	
	(A.7.12)	Wisselkoers	
		Januari	
		Februari	
		Maart	
		April	
		Mei	
		Juni	
		Juli	
		Augustus	

Item		Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
		September	
		Oktober	
		November	
		December	

LVNAV MMF's

	Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
B) VAN TOEPASSING OP LVNAV MMF'S			
		a) Geef elk geval waarin de prijs van activa, gewaardeerd volgens de methode van de geamortiseerde kostprijs overeenkomstig artikel 29, lid 7, eerste alinea, van Verordening (EU) 2017/1131, meer dan 10 basispunten afwijkt van de prijs van deze activa als berekend in overeenstemming met artikel 29, leden 2, 3 en 4, van Verordening (EU) 2017/1131. Deze velden dient u te rapporteren voor elk activum waarvan de prijs, gewaardeerd volgens de methode van de geamortiseerde kostprijs, zo ver zou afwijken.	
	(B.1.1)	Datum waardering (de eerste dag waarop de gebeurtenis zich voordoet)	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(B.1.2)	ISIN activum	ISIN volgens ISO 6166 (alfanumerieke code van 12 tekens)
	(B.1.3)	CFI activum (indien beschikbaar, en indien ISIN niet beschikbaar is)	CFI volgens ISO 10692 (alfabetische code van 6 tekens)
	(B.1.4)	Prijs (artikel 29, leden 2, 3 en 4, van Verordening (EU) 2017/1131) (op de in veld B.1.1 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	
	(B.1.5)	Prijs (volgens methode geamortiseerde kostprijs) (op de in veld B.1.1 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	
	(B.1.6)	Gerekend vanaf de in veld B.1.1 vermelde waarderingsdatum, hoe lang week de prijs van een volgens de methode van de geamortiseerde kostprijs gewaardeerd activum met meer dan 10 basispunten af van de prijs van dat activum?	(in dagen)
	(B.1.7)	Geef voor de in veld B.1.1 vermelde periode het gemiddelde verschil tussen de beide in veld B.1.6 vermelde waarden.	

	Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(B.1.8)	Geef voor de in veld B.1.6 vermelde periode de kleinste prijsafwijking tussen de beide waarden.	
	(B.1.9)	Geef voor de in veld B.1.6 vermelde periode de grootste prijsafwijking tussen de beide waarden.	
		b) Geef elk geval waarin de constante NAV per recht van deelneming of aandeel als berekend in overeenstemming met artikel 32, leden 1 en 2, van Verordening (EU) 2017/1131, met meer dan 20 basispunten afwijkt van de NAV per recht van deelneming of aandeel als berekend in overeenstemming met artikel 30 van Verordening (EU) 2017/1131.	
	(B.1.10)	Datum waardering (de eerste dag waarop de gebeurtenis zich voordoet)	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(B.1.11)	Constante NAV (artikel 31 van Verordening (EU) 2017/1131) (op de in veld B.1.10 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(B.1.12)	Constante NAV (artikel 31 van Verordening (EU) 2017/1131) (op de in veld B.1.10 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	(in basisvaluta)
	(B.1.13)	NAV (artikel 30 van Verordening (EU) 2017/1131) (op de in veld B.1.10 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	(in EUR) (indien de basisvaluta niet de euro is, gebruikt u als wisselkoers de meest recente koers van de Europese Centrale Bank)
	(B.1.14)	NAV (artikel 30 van Verordening (EU) 2017/1131) (op de in veld B.1.10 vermelde waarderingsdatum wanneer de gebeurtenis zich voordoet)	(in basisvaluta)
	(B.1.15)	Gerekend vanaf de in veld B.1.10 vermelde waarderingsdatum, hoe lang week de constante NAV per recht van deelneming of aandeel met meer dan 20 basispunten af van de NAV per recht van deelneming of aandeel?	(in dagen)
	(B.1.16)	Geef voor de periode vermeld in veld B.1.15 het gemiddelde verschil tussen de beide in veld B.1.15 vermelde waarden.	
	(B.1.17)	Geef voor de periode vermeld in veld B.1.15 de kleinste prijsafwijking tussen de beide waarden.	
	(B.1.18)	Geef voor de in veld B.1.15 vermelde periode de grootste prijsafwijking tussen de beide waarden.	
		c) Geef elk geval waarin sprake is van een situatie als bedoeld in artikel 34, lid 3, van Verordening (EU) 2017/1131 en de door de raad van bestuur in overeenstemming met artikel 34, lid 1, onder a) en b), van die verordening genomen maatregelen.	
	(B.1.19)	Data gebeurtenis	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD

	Item	Type gegevens	Gerapporteerde gegevens
	(B.1.20)	Datum waarop maatregel is genomen	Datum volgens ISO 8601 in het formaat JJJJ-MM-DD
	(B.1.21)	Soort maatregel (Wanneer het percentage wekelijks vervallende activa daalt tot onder 30 % van de totale activa van het MMF en wanneer de netto dagelijkse terugbetalingen op één enkele werkdag tot boven 10 % van de totale activa stijgen.)	Liquiditeitsvergoedingen voor terugbetalingen Beperkingen op terugbetalingsverzoeken Opschorting van terugbetalingen Geen onmiddellijke maatregelen, tenzij correctie van de situatie waarin in artikel 24, lid 1, van Verordening (EU) 2017/1131 bedoelde begrenzingen worden overschreden, in overeenstemming met artikel 24, lid 2, van die verordening.
	(B.1.22)	Soort maatregel (Wanneer het aandeel wekelijks vervallende activa daalt tot onder 10 % van de totale activa ervan.)	Liquiditeitsvergoedingen voor terugbetalingen Opschorting van terugbetalingen