REGULAMENTO DE EXECUÇÃO (UE) 2018/708 DA COMISSÃO

de 17 de abril de 2018

que estabelece normas técnicas de execução no que se refere ao modelo a utilizar pelos gestores de fundos do mercado monetário aquando da comunicação às autoridades competentes prevista no artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho

(Texto relevante para efeitos do EEE)

A COMISSÃO EUROPEIA,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta o Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017, relativo aos fundos do mercado monetário ([1]), nomeadamente o artigo 37.º, n.º 4,

Considerando o seguinte:

(1) Além dos requisitos de comunicação estabelecidos pelas Diretivas 2009/65/CE ([2]) e 2011/61/UE do Parlamento Europeu e do Conselho ([3]), são necessários requisitos de comunicação adicionais para assegurar que as autoridades competentes podem, de forma eficaz, detetar, acompanhar e reagir a riscos no mercado de fundos do mercado monetário (FMM).

(2) O artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131 estabelece uma lista detalhada de informações que os FMM devem comunicar às suas autoridades competentes. Para garantir a coerência em toda a União Europeia na forma como estas autoridades recolhem essas informações, assegurar que essas autoridades são informadas dos principais desenvolvimentos do mercado dos FMM e facilitar uma análise coletiva dos impactos potenciais do mercado dos FMM na União, as informações devem ser transmitidas às autoridades competentes de forma uniforme em toda a UE. Além disso, o uso de um modelo normalizado de comunicação facilita a execução dos procedimentos e processos associados aos requisitos de comunicações dos FMM e minimiza os custos associados.

(3) A fim de assegurar uma supervisão eficaz na União, tais informações devem ser transmitidas à Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA), para que seja criada uma base de dados central dos FMM.

(4) O presente regulamento baseia-se nos projetos de normas técnicas de execução apresentados pela ESMA à Comissão.

(5) A ESMA conduziu uma consulta pública aberta sobre os projetos de normas técnicas de execução que servem de base ao presente regulamento, analisou os seus potenciais custos e benefícios e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados, criado pelo artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ([4]).

(6) A data de aplicação do presente regulamento de execução deverá ser alinhada com a data de aplicação do Regulamento (UE) 2017/1131, de forma a permitir que as autoridades nacionais recolham as informações que devem transmitir à ESMA para efeitos da base de dados referida no artigo 37.º, n.º 5, do Regulamento (UE) 2017/1131,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Os gestores de fundos do mercado monetário (FMM) devem utilizar o modelo constante do anexo do presente regulamento aquando da comunicação à autoridade competente de um dado FMM, prevista no artigo 37.º do Regulamento (UE) 2017/1131.

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

([2]) Diretiva 2009/65/CE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 13 de julho de 2009, que coordena as disposições legislativas, regulamentares e administrativas respeitantes a alguns organismos de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM) (reformulação) (JO L 302 de 17.11.2009, p. 32).

([3]) Diretiva 2011/61/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 8 de junho de 2011, relativa aos gestores de fundos de investimento alternativos e que altera as Diretivas 2003/41/CE e 2009/65/CE e os Regulamentos (CE) n.º 1060/2009 e (UE) n.º 1095/2010 (JO L 174 de 1.7.2011, p. 1).

([4]) Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/77/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

Artigo 2.º

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é aplicável a partir de 21 de julho de 2018.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 17 de abril de 2018.

Pela Comissão

O Presidente

Jean-Claude JUNCKER

ANEXO

Modelo de comunicação para os gestores de fundos do mercado monetário (FMM)

Salvo indicação em contrário, todos os valores devem ser preenchidos a nível do subfundo

Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
A) APLICÁVEL A TODOS OS FMM		
(1) **Características gerais, identificação do FMM e do gestor desse FMM**		
(A.1.1)	Período de relato	
(A.1.2)	Código nacional do FMM fornecido pela autoridade competente do FMM	
(A.1.3)	LEI do FMM	Código identificador de entidade jurídica (LEI) ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
(A.1.4)	Código BCE (código de identificação da IFM) do FMM	
(A.1.5)	Nome do FMM	
(A.1.6)	Indicar se o FMM é um OICVM ou um FIA	OICVM FIA
(A.1.7)	Indicar se o FMM é comercializado exclusivamente através de um regime de aforro de trabalhadores regulado pelo direito nacional e só tem como investidores pessoas singulares (nos termos do artigo 16.º, n.º 5, do Regulamento (UE) 2017/1131 ([1]))	(Sim/Não)
(A.1.8)	Sede do FMM	Código de país ISO 3166
(A.1.9)	Estado-Membro onde o FMM é autorizado	Código de país ISO 3166
(A.1.10)	Estado-Membro onde o FMM é comercializado	Lista de países (Código de país ISO 3166)
(A.1.11)	Data de início do FMM	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
(A.1.12)	Moeda de base do FMM	Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos

([1]) Regulamento (UE) 2017/1131 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017, relativo aos fundos do mercado monetário

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.1.13)	Código nacional do gestor do FMM fornecido pela autoridade competente do FMM	
	(A.1.14)	Código nacional do gestor do FMM fornecido pela autoridade competente do gestor do FMM	
	(A.1.15)	LEI do gestor do FMM	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.1.16)	Código BCE (código de identificação da IFM) do gestor do FMM	
	(A.1.17)	Nome do gestor do FMM	
	(A.1.18)	País onde o gestor do FMM está autorizado	
	(A.1.19)	LEI do depositário do FMM	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.1.20)	Código nacional do depositário do FMM	
	(A.1.21)	Denominação legal do depositário do FMM	
	(2) **Tipo do FMM**		
	(A.2.1)	Tipo de FMM [Selecionar uma opção]	FMM VLV de curto prazo FMM de dívida pública VLC de curto prazo FMM VBLV de curto prazo FMM VLV normal
	(3) **Outras características do FMM**		
	a) *Informações sobre o fundo principal/de alimentação* (FMM comercializado exclusivamente através de um regime de aforro de trabalhadores regulado pelo direito nacional e que tem como investidores pessoas singulares)		
	(A.3.1)	Se o FMM cumpre as condições estabelecidas no artigo 16.º, n.º 5, do Regulamento (UE) 2017/1131, indicar se o FMM é um fundo principal ou um fundo de alimentação [selecionar uma opção]	Principal De alimentação
	Se o FMM é de alimentação:		
	(A.3.2)	LEI do fundo principal do FMM	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.3.3)	Código nacional do fundo principal do FMM	
	(A.3.4)	Denominação legal do fundo principal do FMM	
	b) *Informações sobre categorias de ações*		
	(A.3.5)	Indicar se o FMM tem categorias de ações	(Sim/Não)
	(A.3.6)	Se o FMM tem categorias de ações, indicar o código ISIN único de cada categoria de ações	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.3.7)	Se o FMM tem categorias de ações, indicar a moeda das diferentes categorias de ações	Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos
	c) *Informações sobre o fundo anterior ou liquidação (relato pontual)*		
	Se o FMM foi fundido com outro fundo, indicar:		
	(A.3.8)	Data de fusão.	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	Se o FMM está em fase de liquidação, indicar:		
	(A.3.9)	Data de liquidação.	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(4) **Indicadores de carteira do FMM**		
	a) *Valor total dos ativos (para efeitos do modelo de comunicação ao abrigo do Regulamento FMM, considera-se que o valor total dos ativos equivale ao valor líquido - ver o campo A.4.1 infra)*		
	b) *VL (a nível do subfundo, não da categoria de ações)*		
	(A.4.1)	Valor líquido do FMM (a nível do subfundo)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.4.2)	Valor líquido do FMM	(na moeda de base)
	c) *MMP*		
	(A.4.3)	Maturidade média ponderada do FMM calculada nos termos do artigo 2.º, ponto 19, do Regulamento (UE) 2017/1131.	(dias)

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	d) *DMP*		
	(A.4.4)	Duração média ponderada do FMM calculada nos termos do artigo 2.º, ponto 20, do artigo 24.º, n.º 1, alínea b), e do artigo 25.º, n.º 1, alínea b), do Regulamento (UE) 2017/1131.	(dias)
	e) *Indicadores de liquidez*		
	Perfil de liquidez da carteira		
	(A.4.5)	% de ativos elegíveis para a reserva diária de liquidez (ativos com maturidade diária na aceção dos artigos 24.º e 25.º do Regulamento (UE) 2017/1131)	%
	(A.4.6)	% de ativos elegíveis para a reserva semanal de liquidez (ativos com maturidade semanal na aceção dos artigos 24.º e 25.º do Regulamento (UE) 2017/1131)	%
	(A.4.7)	Perfil de liquidez da carteira	Percentagem da carteira suscetível de ser liquidada em cada período
Período	1 dia ou menos ☐	2 - 7 dias ☐	8 - 30 dias ☐ Mais de 30 dias ☐
	f) *Rendimento*		
	(A.4.8)	Retornos cumulados	%
Intervalo de variação	Do início do exercício até à data ☐	1 mês ☐	3 meses ☐ 1 ano ☐ 3 anos ☐ 5 anos ☐
	(A.4.9)	Resultado do ano civil (retorno líquido) da categoria de ações mais representativa	%
Intervalo de variação	Ano N-1 ☐	Ano N-2 ☐	Ano N-3 ☐
	(A.4.10)	Volatilidade mensal da carteira e volatilidade mensal da carteira do VL paralelo (se aplicável)	%
Intervalo de variação	1 ano ☐	2 anos ☐	3 anos ☐

Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
(5) **Testes de esforço do FMM**		
a) *Resultados dos testes de esforço do FMM*		
(A.5.1)	Resultados dos testes de esforço relativos à liquidez do FMM realizados durante o período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas correspondentes orientações da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.2)	Resultados dos testes de esforço relativos ao risco de crédito do FMM realizados no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas correspondentes orientações da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.3)	Resultados dos testes de esforço relativos às taxas de câmbio do FMM realizados no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas correspondentes orientações da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.4)	Resultados dos testes de esforço relativos às taxas de juro do FMM realizados no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas orientações correspondentes da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.5)	Resultados do teste de esforço relativo ao nível de resgate do FMM realizado no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas orientações correspondentes da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.6)	Resultados do teste de esforço do FMM relativo ao diferencial entre os índices a que as taxas de juro dos valores mobiliários em carteira estão ligadas, realizado no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas orientações correspondentes da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
(A.5.7)	Resultados do teste de esforço relativo a choques macroeconómicos do FMM, realizado no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas orientações correspondentes da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.5.8)	Resultados do teste de esforço relativo a várias variáveis do FMM, realizado no período de relato, como disposto no artigo 28.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 e nas orientações correspondentes da ESMA sobre os cenários de testes de esforço	
	(A.5.9)	No caso dos FMM VLC e dos FMM VLBV, indicar os resultados dos testes de esforço referidos nos campos A.5.1 a A.5.8 relativamente à diferença entre o VL constante por unidade de participação ou ação e o VL por unidade de participação ou ação	
	b) *Proposta de plano de ação (se aplicável)*		
	(A.5.10)	Indicar a proposta de plano de ação como disposto no artigo 28.º, n.º 4, do Regulamento (UE) 2017/1131	Texto livre
	(6) **Informações sobre os ativos detidos na carteira do FMM**		
	a) *Instrumentos do mercado monetário, e titularizações e papéis comerciais garantidos por ativos elegíveis*		
	O campo A.6 infra deve ser preenchido utilizando um modelo de relato linha a linha		
	(A.6.1)	Tipo do instrumento do mercado monetário, e de titularizações e papéis comerciais garantidos por ativos elegíveis [selecionar uma ou várias opções]	
		Indicar o tipo de instrumentos do mercado monetário, e de titularizações e papéis comerciais garantidos por ativos elegíveis	Instrumentos do mercado monetário nos termos do artigo 10.º do Regulamento (UE) 2017/1131 Titularizações a que se refere o artigo 13.º do Regulamento Delegado (UE) 2015/61 da Comissão ([2]) ABCP a que se refere o artigo 11.º, n.º 1, alínea b), do Regulamento (UE) 2017/1131 Uma titularização ou um ABCP simples, transparente e normalizado, a que se refere o artigo 11.º, n.º 1, alínea c), do Regulamento (UE) 2017/1131
		Se o tipo de ativo for um instrumento do mercado monetário, preencher os campos A.6.2 a A.6.20	
	(A.6.2)	Descrição dos ativos do instrumento do mercado monetário	
	(A.6.3)	ISIN do instrumento do mercado monetário	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos

([2]) Regulamento Delegado (UE) 2015/61 da Comissão, de 10 de outubro de 2014, que completa o Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho, no que diz respeito ao requisito de cobertura de liquidez para as instituições de crédito (JO L 11 de 17.1.2015, p. 1).

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.6.4)	CFI (se disponível e se o ISIN não estiver disponível) do instrumento do mercado monetário	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(A.6.5)	LEI do emitente	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.6.6)	Nome do emitente	
	(A.6.7)	Categoria de emitentes A categoria de emitentes deve ser selecionada entre as correspondentes [selecionar uma opção]	Soberano (UE) Soberano (não pertencente à UE) Banco central da UE Banco central não pertencente à UE Regional Local Organismo público nacional Organismo público da UE (exceto organismo público nacional) Organismo público não pertencente à UE Organismo público supranacional (UE) Organismo público supranacional (não pertencente à UE) Instituição de crédito Outras empresas financeiras Empresas não financeiras
	(A.6.8)	País do emitente do instrumento do mercado monetário	Código de país ISO 3166
	(A.6.9)	Data de vencimento do instrumento do mercado monetário	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.10)	Moeda do instrumento do mercado monetário	(Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos)
	(A.6.11)	Quantidade do instrumento do mercado monetário	
	(A.6.12)	Cotação líquida do instrumento do mercado monetário	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.13)	Cotação líquida do instrumento do mercado monetário	(na moeda de base)
	(A.6.14)	Juros vencidos	

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.6.15)	Juros vencidos	(na moeda de base, se A.6.14 estiver expresso em EUR)
	(A.6.16)	Valor de mercado total do instrumento do mercado monetário	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.17)	Valor de mercado total do instrumento do mercado monetário	(na moeda de base)
	(A.6.18)	Método utilizado para avaliar o preço do instrumento do mercado monetário	Ao preço do mercado Com recurso a um modelo Custo amortizado
	(A.6.19)	Indicar se o resultado do procedimento de avaliação interna da qualidade de crédito é favorável ou desfavorável	(favorável/desfavorável)
	(A.6.20)	Indicar a data de revisão seguinte da taxa de juro (referida no artigo 10.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2017/1131)	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
		Se o tipo de ativo for uma titularização ou um papel comercial garantido por ativos elegível, preencher os campos A.6.21 a A.6.37	
	(A.6.21)	Descrição dos ativos da titularização ou do papel comercial garantido por ativos elegível	
	(A.6.22)	ISIN da titularização ou papel comercial garantido por ativos elegível	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.6.23)	País do patrocinador da titularização e papel comercial garantido por ativos elegível	Código de país ISO 3166
	(A.6.24)	LEI do patrocinador	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.6.25)	Nome do patrocinador	
	(A.6.26)	Tipo de ativo subjacente	Contas a receber comerciais Créditos ao consumo Locações Contas a receber de cartões de crédito Empréstimos a empresas ou PME Crédito hipotecário para habitação Crédito hipotecário comercial Outros ativos

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.6.27)	Data de vencimento	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.28)	Moeda	(Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos)
	(A.6.29)	Quantidade	
	(A.6.30)	Cotação líquida	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.31)	Cotação líquida	(na moeda de base)
	(A.6.32)	Juros vencidos	
	(A.6.33)	Juros vencidos	(na moeda de base, se A.6.30 estiver expresso em EUR)
	(A.6.34)	Valor de mercado total	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.35)	Valor de mercado total	(na moeda de base)
	(A.6.36)	Método utilizado para avaliar o preço das titularizações ou papéis comerciais garantidos por ativos elegíveis	Ao preço do mercado Com recurso a um modelo Custo amortizado
	(A.6.37)	Se o resultado do procedimento de avaliação interna da qualidade de crédito é favorável ou desfavorável	(favorável/desfavorável)
	b) *Outros ativos*		
	(A.6.38)	Tipo dos outros ativos [selecionar uma opção] O tipo dos outros ativos deve ser selecionado entre os ativos enumerados no artigo 9.º do Regulamento (UE) 2017/1131	Depósitos em instituições de crédito, referidos no artigo 12.º do Regulamento (UE) 2017/1131 Acordos de revenda, referidos no artigo 15.º do Regulamento (UE) 2017/1131 Acordos de recompra, referidos no artigo 14.º do Regulamento (UE) 2017/1131 Unidades de participação ou ações de outros FMM, referidos no artigo 16.º do Regulamento (UE) 2017/1131

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
			Instrumentos financeiros derivados, referidos no artigo 13.º do Regulamento (UE) 2017/1131, dos quais: — Instrumentos financeiros derivados negociados num mercado regulamentado (e especificar se se enquadram no artigo 50.º, n.º 1, alínea a), b) ou c), da Diretiva 2009/65/CE) — Instrumentos financeiros derivados negociados no mercado de balcão Ativos líquidos a título acessório (nos termos do artigo 50.º, n.º 2, da Diretiva 2009/65/CE)
		Se o tipo de outro ativo for um instrumento financeiro derivado, preencher os campos A.6.39 a A.6.60	
	(A.6.39)	Tipo de contrato de derivados	
	(A.6.40)	ISIN do instrumento financeiro derivado	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.6.41)	UPI do instrumento financeiro derivado (se o ISIN não estiver disponível)	
	(A.6.42)	Código FISN (nome abreviado do instrumento financeiro) do instrumento financeiro derivado	ISO 18774
	(A.6.43)	CFI (se disponível e se o ISIN não estiver disponível) do instrumento financeiro derivado	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(A.6.44)	Tipo de instrumento derivado previsto no artigo 13.º, alínea a), do Regulamento (UE) 2017/1131 [selecionar uma opção]	Taxa de juro Divisas Índices de taxas de juro Índices de divisas
	(A.6.45)	Nome do ativo subjacente	
	(A.6.46)	Tipo de identificação do ativo subjacente ([3])	I = ISIN X = Índice

([3]) Identificação de derivados financeiros no Regulamento relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (EMIR)

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.6.47)	Identificação do ativo subjacente	Para a identificação de ativos subjacentes do tipo I: Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos Para a identificação de ativos subjacentes do tipo X: Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos, quando disponível, caso contrário nome completo do índice atribuído pelo respetivo fornecedor
	(A.6.48)	Moeda nocional 1 ([4])	Código de moeda ISO 4217
	(A.6.49)	Moeda nocional 2 ([5])	Código de moeda ISO 4217
	(A.6.50)	País do instrumento financeiro derivado	Código de país ISO 3166
	(A.6.51)	Data de vencimento do instrumento financeiro derivado	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.52)	Exposição do instrumento financeiro derivado	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.53)	Exposição do instrumento financeiro derivado	(na moeda de base)
	(A.6.54)	Valor de mercado do instrumento financeiro derivado	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.55)	Valor de mercado do instrumento financeiro derivado	(na moeda de base)
	(A.6.56)	Valor de mercado das garantias recebidas (em relação ao instrumento financeiro derivado)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.57)	Valor de mercado das garantias recebidas (em relação ao instrumento financeiro derivado)	(na moeda de base)
	(A.6.58)	Indicar a data de revisão seguinte da taxa de juro (referida no artigo 10.º, n.º 2, do Regulamento (UE) 2017/1131)	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.59)	Nome da contraparte	
	(A.6.60)	LEI da contraparte	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos

([4]) A moeda em que é expresso o montante nocional. No caso de um contrato de derivados sobre taxas de juro, esta será a moeda nocional da componente 1.
([5]) A moeda em que é expresso o montante nocional. No caso de um contrato de derivados sobre taxas de juro, esta será a moeda nocional da componente 2.

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
		Se o tipo de outro ativo for uma unidade de participação ou ação de outro FMM, preencher os campos A.6.61 a A.6.71	
	(A.6.61)	Descrição dos ativos da unidade de participação ou ação de outro FMM	
	(A.6.62)	ISIN da unidade de participação ou ação de outro FMM	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.6.63)	LEI (se o código ISIN não estiver disponível) da unidade de participação ou ação de outro FMM	
	(A.6.64)	CFI (se disponível e se o ISIN não estiver disponível) da unidade de participação ou ação de outro FMM	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(A.6.65)	Moeda	(Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos)
	(A.6.66)	País da unidade de participação ou ação de outro FMM	Código de país ISO 3166
	(A.6.67)	Valor de mercado da unidade de participação ou ação de outro FMM	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.68)	Valor de mercado da unidade de participação ou ação de outro FMM	(na moeda de base)
	(A.6.69)	Quantidade	
	(A.6.70)	Preço da unidade de participação ou ação de outro FMM (VL por unidade de participação ou ação de outro FMM)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.71)	Preço da unidade de participação ou ação de outro FMM (VL por unidade de participação ou ação de outro FMM)	(na moeda de base)
		Se o tipo de outro ativo for um depósito ou ativos líquidos a título acessório, preencher os campos A.6.72 a A.6.81	
	(A.6.72)	Descrição dos ativos do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	
	(A.6.73)	ISIN do depósito ou ativos líquidos a título acessório	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.6.74)	CFI (se disponível e se o ISIN não estiver disponível) do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(A.6.75)	País do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	Código de país ISO 3166

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.6.76)	Nome da contraparte	
	(A.6.77)	LEI da contraparte	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.6.78)	Data de vencimento do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.79)	Moeda	(Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos)
	(A.6.80)	Exposição do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.81)	Exposição do depósito ou dos ativos líquidos a título acessório	(na moeda de base)
		Se o tipo de outro ativo corresponder aos ativos de um acordo de recompra ou de um acordo de revenda, preencher os campos A.6.82 a A.6.99	
	(A.6.82)	Descrição dos ativos do acordo de recompra ou do acordo de revenda	
	(A.6.83)	ISIN do acordo de recompra ou do acordo de revenda	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(A.6.84)	CFI (se disponível e se ISIN não estiver disponível) do acordo de recompra ou do acordo de revenda	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(A.6.85)	País do acordo de recompra ou do acordo de revenda	Código de país ISO 3166
	(A.6.86)	Categoria da contraparte A categoria de contraparte deve ser selecionada entre as seguintes (ver artigo 20.º, n.º 2, alínea e), do Regulamento (UE) 2017/1131) [selecionar uma opção]	Soberano (UE) Soberano (não pertencente à UE) Banco central da UE Banco central não pertencente à UE Regional Local Organismo público nacional Organismo público da UE (exceto organismo público nacional) Organismo público não pertencente à UE Organismo público supranacional (UE) Organismo público supranacional (não pertencente à UE)

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
			Instituição de crédito Outras empresas financeiras Empresas não financeiras
	(A.6.87)	LEI da contraparte	Código LEI ISO 17442, com 20 carateres alfanuméricos
	(A.6.88)	Nome da contraparte	
	(A.6.89)	Data de vencimento do acordo de recompra ou do acordo de revenda	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(A.6.90)	Moeda	(Código de moeda ISO 4217, com 3 carateres alfabéticos)
	(A.6.91)	Exposição do acordo de recompra ou do acordo de revenda (no caso do acordo de revenda, corresponde ao montante de dinheiro entregue à contraparte)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.92)	Exposição do acordo de recompra ou do acordo de revenda (no caso do acordo de revenda, corresponde ao montante de dinheiro entregue à contraparte)	(na moeda de base)
	(A.6.93)	Valor de mercado da garantia recebida (em relação ao acordo de recompra ou acordo de revenda) (o montante de dinheiro recebido pelo FMM como parte dos acordos de recompra) (como referido no artigo 14.º, alínea d), do Regulamento (UE) 2017/1131)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(A.6.94)	Valor de mercado da garantia recebida (em relação ao acordo de recompra ou acordo de revenda) (o montante de dinheiro recebido pelo FMM como parte dos acordos de recompra) (como referido no artigo 14.º, alínea d), do Regulamento (UE) 2017/1131)	(na moeda de base)
	(A.6.95)	Se o resultado do procedimento de avaliação interna da qualidade de crédito é favorável ou desfavorável (para os diferentes valores mobiliários líquidos ou (outros) instrumentos do mercado monetário recebidos no âmbito de um acordo de revenda como referido no artigo 15.º, n.º 6, do Regulamento (UE) 2017/1131 [6]	(favorável/desfavorável)

[6] Se o FMM receber como garantia diferentes ativos na aceção do artigo 15.º, n.º 6, do Regulamento (UE) 2017/1131, o resultado deve ser comunicado para cada ativo.

Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
No âmbito dos acordos de revenda e dos ativos referidos no artigo 15.º do Regulamento (UE) 2017/1131 recebidos pelo FMM, indicar:		
(A.6.96)	ISIN destes diferentes ativos	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
(A.6.97)	Valor de mercado destes diferentes ativos	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
(A.6.98)	Valor de mercado destes diferentes ativos	(na moeda de base)
(A.6.99)	No âmbito dos acordos de revenda, se o FMM recebeu algum ativo referido no artigo 15.º, n.º 6, do Regulamento (UE) 2017/1131	(Sim/Não)
(7) **Informações sobre os passivos do FMM**		
a) *Informações sobre os investidores – concentração dos investidores*		
(A.7.1)	Especificar a percentagem aproximada do capital próprio do FMM que é efetivamente detido pelos cinco beneficiários efetivos que detêm a maior participação no capital do FMM, em percentagem do valor líquido do FMM. Analisar os últimos beneficiários efetivos, quando conhecidos ou quando possível	% (do VL)
b) *Informações sobre os investidores – repartição da concentração dos investidores*		
(A.7.2)	Especificar a repartição da concentração dos investidores por estatuto dos investidores (estimativa, na ausência de informações precisas): 1) Clientes profissionais (na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea 10), da Diretiva 2014/65/UE do Parlamento Europeu e do Conselho (7) (MiFID 2)) 2) Clientes não profissionais (na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea 11), da Diretiva 2014/65/UE (MiFID 2))	
	— Clientes profissionais (na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea 10), da Diretiva 2014/65/UE (MiFID 2))	% (do VL)
	— Clientes não profissionais (na aceção do artigo 4.º, n.º 1, alínea 11), da Diretiva 2014/65/UE (MiFID 2))	% (do VL)

(7) Diretiva 2014/65/UE, do Parlamento Europeu e do Conselho, de 15 de maio de 2014, relativa aos mercados de instrumentos financeiros e que altera a Diretiva 2002/92/CE e a Diretiva 2011/61/UE

Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
c) *Informações sobre os investidores – repartição geográfica*		
(A.7.3)	Indicar a repartição da propriedade das unidades de participação/ações do FMM por grupo de investidores. Analisar os últimos beneficiários efetivos, quando conhecidos ou quando possível.	(% do VL) Empresas não financeiras Bancos Empresas de seguros Outras instituições financeiras Planos/fundos de pensões Administrações públicas Outros organismos de investimento coletivo Famílias Desconhecido
(A.7.4)	Especificar a repartição geográfica dos investidores por país (estimativa, na ausência de informações precisas)	
	País	(% do VL, Código do país ISO 3166 com 2 carateres)
d) *Informações sobre os investidores – atividades de subscrição e de resgate*		
Resgates dos investidores		
(A.7.5)	Indicar a frequência dos resgates dos investidores. Caso haja várias categorias de ações ou unidades de participação, comunicar os dados relativos à maior categoria de ações ou unidades de participação em termos de VL. [selecionar uma opção]	Diária Semanal Mensal Bimestral Outra Ausência de direitos de resgate
(A.7.6)	Qual é o período (em dias) de pré-aviso exigido pelos investidores para o resgate?	Dias
(A.7.7)	À data de relato, que percentagem do VL do FMM está sujeita ao seguinte:	
	Restrições	% do VL

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
		Suspensão da negociação	% do VL
		Comissões de liquidez	% do VL
		Outros regimes de gestão de ativos ilíquidos	Tipo de regime
			% do VL
	(A.7.8)	Valor líquido do FMM durante o período de relato	(em EUR, incluindo o impacto das subscrições e resgates) (no último dia do mês)
		janeiro	
		fevereiro	
		março	
		abril	
		maio	
		junho	
		julho	
		agosto	
		setembro	
		outubro	
		novembro	
		dezembro	
	(A.7.9)	Subscrições durante o período de relato	(em EUR)
		janeiro	
		fevereiro	
		março	
		abril	

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
		maio	
		junho	
		julho	
		agosto	
		setembro	
		outubro	
		novembro	
		dezembro	
	(A.7.10)	Resgates durante o período de relato	(em EUR)
		janeiro	
		fevereiro	
		março	
		abril	
		maio	
		junho	
		julho	
		agosto	
		setembro	
		outubro	
		novembro	
		dezembro	

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
	(A.7.11)	Pagamentos aos investidores	(em EUR)
		janeiro	
		fevereiro	
		março	
		abril	
		maio	
		junho	
		julho	
		agosto	
		setembro	
		outubro	
		novembro	
		dezembro	
	(A.7.12)	Taxa de câmbio	
		janeiro	
		fevereiro	
		março	
		abril	
		maio	
		junho	
		julho	
		agosto	

Elemento		Tipo de dados	Dados comunicados
		setembro	
		outubro	
		novembro	
		dezembro	

FMM VLBV

	Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
B) APLICÁVEIS AOS FMM VLBV			
		a) Indicar todas as ocorrências em que o preço de um ativo avaliado utilizando o método do custo amortizado em conformidade com o artigo 29.º, n.º 7, primeiro parágrafo, do Regulamento (UE) 2017/1131, divergiu em mais de 10 pontos de base do preço desse mesmo ativo calculado nos termos do artigo 29.º, n.os 2, 3 e 4, do Regulamento (UE) 2017/1131. Estes campos devem ser preenchidos para cada ativo cujo preço, ao utilizar o método do custo amortizado, divergiria dessa forma.	
	(B.1.1)	Data de avaliação (o primeiro dia em que se regista a ocorrência)	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(B.1.2)	ISIN do ativo	Código ISIN ISO 6166, com 12 carateres alfanuméricos
	(B.1.3)	CFI (se disponível e se o ISIN não estiver disponível) do ativo	CFI ISO 10692, com 6 carateres alfabéticos
	(B.1.4)	Preço (artigo 29.º, n.os 2, 3 e 4, do Regulamento (UE) 2017/1131) (à data de avaliação referida no campo B.1.1, quando se regista a ocorrência)	
	(B.1.5)	Preço (método do custo amortizado) (à data de avaliação referida no campo B.1.1, quando se regista a ocorrência)	
	(B.1.6)	A partir da data de avaliação especificada no campo B.1.1, indicar durante quanto tempo o preço de um ativo avaliado utilizando o método do custo amortizado divergiu em mais de 10 pontos de base do preço do mesmo ativo	(dias)
	(B.1.7)	Durante o período mencionado no campo B.1.6, indicar a diferença média entre os dois valores mencionados no campo B.1.6	

	Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
	(B.1.8)	Durante o período mencionado no campo B.1.6, indicar a divergência mínima de preço entre os dois valores	
	(B.1.9)	Durante o período mencionado no campo B.1.6, indicar a divergência máxima de preço entre os dois valores	
		b) Indicar todas as ocorrências em que o VL constante por unidade de participação ou ação calculado em conformidade com o artigo 32.º, n.os 1 e 2, do Regulamento (UE) 2017/1131, divergiu em mais de 20 pontos de base do VL por unidade de participação ou ação calculado em conformidade com o artigo 30.º do Regulamento (UE) 2017/1131.	
	(B.1.10)	Data de avaliação (o primeiro dia em que se regista a ocorrência)	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(B.1.11)	VL constante (artigo 31.º do Regulamento (UE) 2017/1131) (à data de avaliação referida no campo B.1.10, quando se regista a ocorrência)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(B.1.12)	VL constante (artigo 31.º do Regulamento (UE) 2017/1131) (à data de avaliação referida no campo B.1.10, quando se regista a ocorrência)	(na moeda de base)
	(B.1.13)	VL (artigo 30.º do Regulamento (UE) 2017/1131) (à data de avaliação referida no campo B.1.10, quando se regista a ocorrência)	(em EUR) (se a moeda de base não for o EUR, a taxa de câmbio utilizada deve ser a última taxa fixada pelo Banco Central Europeu)
	(B.1.14)	VL (artigo 30.º do Regulamento (UE) 2017/1131) (à data de avaliação referida no campo B.1.10, quando se regista a ocorrência)	(na moeda de base)
	(B.1.15)	A partir da data de avaliação especificada no campo B.1.10, indicar durante quanto tempo o VL constante por unidade de participação ou ação calculado divergiu em mais de 20 pontos de base do VL por unidade de participação ou ação calculado	(dias)
	(B.1.16)	Durante o período mencionado no campo B.1.15, indicar a divergência média entre os dois valores mencionados no campo B.1.15	
	(B.1.17)	Durante o período mencionado no campo B.1.15, indicar a divergência mínima de preço entre os dois valores	
	(B.1.18)	Durante o período mencionado no campo B.1.15, indicar a divergência máxima de preço entre os dois valores	
		c) Indicar todas as ocorrências de uma situação referida no artigo 34.º, n.º 3, do Regulamento (UE) 2017/1131, e as medidas tomadas pelo conselho de administração, nos termos do artigo 34.º, n.º 1, alíneas a) e b), do mesmo regulamento.	
	(B.1.19)	Data da ocorrência	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD

	Elemento	Tipo de dados	Dados comunicados
	(B.1.20)	Data em que a medida foi tomada	Data ISO 8601 no formato AAAA-MM-DD
	(B.1.21)	Tipo de medida (Sempre que a proporção de ativos com maturidade semanal diminua para menos de 30 % do total dos ativos do FMM e que os resgates diários líquidos num mesmo dia útil excederem 10 % do total dos ativos)	Comissões de liquidez sobre os resgates Restrições aos resgates Suspensão dos resgates Agir unicamente de forma a corrigir uma situação em que os limites referidos no artigo 24.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/1131 sejam excedidos, em conformidade com o artigo 24.º, n.º 2, do mesmo regulamento
	(B.1.22)	Tipo de medida (Sempre que a proporção de ativos com maturidade semanal diminua para menos de 10 % do total dos seus ativos)	Comissões de liquidez sobre os resgates Suspensão dos resgates