REGULAMENTUL DE PUNERE ÎN APLICARE (UE) 2018/708 AL COMISIEI

din 17 aprilie 2018

de stabilire a unor standarde tehnice de punere în aplicare cu privire la modelul care trebuie utilizat de către administratorii fondurilor de piață monetară la raportarea către autoritățile competente, astfel cum se prevede la articolul 37 din Regulamentul (UE) 2017/1131 al Parlamentului European și al Consiliului

(Text cu relevanță pentru SEE)

COMISIA EUROPEANĂ,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Regulamentul (UE) 2017/1131 al Parlamentului European și al Consiliului din 14 iunie 2017 privind fondurile de piață monetară ([1]), în special articolul 37 alineatul (4),

întrucât:

(1) În plus față de cerințele de raportare prevăzute în Directivele 2009/65/CE ([2]) și 2011/61/UE ([3]) ale Parlamentului European și ale Consiliului, sunt necesare cerințe de raportare suplimentare pentru a se asigura faptul că autoritățile competente pot efectiv să detecteze, să monitorizeze și să răspundă la riscurile de pe piața fondurilor de piață monetară (FPM).

(2) Articolul 37 din Regulamentul (UE) 2017/1131 prevede ca FPM să le transmită autorităților lor competente o listă detaliată de informații. Pentru a se asigura coerența în întreaga Uniune Europeană în ceea ce privește modul în care aceste autorități colectează astfel de date și pentru a se asigura că autoritățile respective sunt informate cu privire la principalele evoluții de pe piața FPM și pot facilita o analiză colectivă a efectelor potențiale asupra pieței FPM din Uniune, informațiile trebuie să fie comunicate autorităților competente în mod uniform pe întreg teritoriul UE. În plus, prin utilizarea unui model standard de raportare se facilitează desfășurarea procedurilor și proceselor asociate cerințelor de raportare ale FPM și se reduc la minimum costurile conexe.

(3) Pentru a se asigura o supraveghere eficace în cadrul Uniunii, astfel de date trebuie comunicate Autorității Europene pentru Valori Mobiliare și Piețe (ESMA), astfel încât să se instituie o bază de date centrală pentru FPM.

(4) Prezentul regulament se bazează pe proiectul de standarde tehnice de punere în aplicare înaintat Comisiei de către ESMA.

(5) ESMA a efectuat o consultare publică deschisă cu privire la proiectul de standarde tehnice de punere în aplicare pe care se bazează prezentul regulament, a analizat costurile și beneficiile potențiale aferente și a solicitat avizul Grupului părților interesate din domeniul valorilor mobiliare și piețelor, instituit în conformitate cu articolul 37 din Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului ([4]).

(6) Data aplicării prezentului regulament de punere în aplicare ar trebui să fie aliniată cu data de la care se aplică Regulamentul (UE) 2017/1131, pentru a se permite autorităților naționale să colecteze informațiile care trebuie transmise în baza de date a ESMA menționată la articolul 37 alineatul (5) din Regulamentul (UE) 2017/1131,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

Articolul 1

Administratorii fondurilor de piață monetară (FPM) utilizează modelul din anexa la prezentul regulament atunci când raportează către autoritatea competentă a unui anumit FPM, astfel cum se prevede la articolul 37 din Regulamentul (UE) 2017/1131.

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

([2]) Directiva 2009/65/CE a Parlamentului European și a Consiliului din 13 iulie 2009 de coordonare a actelor cu putere de lege și a actelor administrative privind organismele de plasament colectiv în valori mobiliare (OPCVM) (reformare) (JO L 302, 17.11.2009, p. 32).

([3]) Directiva 2011/61/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 8 iunie 2011 privind administratorii fondurilor de investiții alternative și de modificare a Directivelor 2003/41/CE și 2009/65/CE și a Regulamentelor (CE) nr. 1060/2009 și (UE) nr. 1095/2010 (JO L 174, 1.7.2011, p. 1).

([4]) Regulamentul (UE) nr. 1095/2010 al Parlamentului European și al Consiliului din 24 noiembrie 2010 de instituire a Autorității europene de supraveghere (Autoritatea europeană pentru valori mobiliare și piețe), de modificare a Deciziei nr. 716/2009/CE și de abrogare a Deciziei 2009/77/CE a Comisiei (JO L 331, 15.12.2010, p. 84).

Articolul 2

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Se aplică de la 21 iulie 2018.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în toate statele membre.

Adoptat la Bruxelles, 17 aprilie 2018.

Pentru Comisie

Președintele

Jean-Claude JUNCKER

ANEXĂ

Model de raportare pentru administratorii de fonduri de piață monetară (FPM)

Cu excepția cazului în care se prevede altfel, toate cifrele se completează la nivel de subfond

Post	Tip de date	Date raportate
(A) SE APLICĂ TUTUROR FPM		
	(1) **Caracteristicile generale, datele de identificare ale FPM și ale administratorului respectivului FPM**	
(A.1.1)	Perioada de raportare	
(A.1.2)	Codul național al FPM stabilit de autoritatea competentă a FPM	
(A.1.3)	Codul LEI al FPM	Identificatorul entității juridice în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice (LEI)
(A.1.4)	Codul BCE (codul de identificare IFM) al FPM	
(A.1.5)	Denumirea FPM	
(A.1.6)	A se indica dacă FPM este un OPCVM sau un FIA	OPCVM FIA
(A.1.7)	A se indica dacă FPM este comercializat numai prin intermediul sistemelor de economii destinate angajaților, potrivit legislației naționale, și are drept investitori persoane fizice [în conformitate cu articolul 16 alineatul (5) din Regulamentul (UE) 2017/1131 ([1])]	(Da/Nu)
(A.1.8)	Domiciliul FPM	ISO 3166 – codul țării
(A.1.9)	Statul membru în care FPM este autorizat	ISO 3166 – codul țării
(A.1.10)	Statul membru în care FPM este comercializat	Lista țărilor (ISO 3166 – codul țării)
(A.1.11)	Data creării FPM	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
(A.1.12)	Moneda de bază a FPM	Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice

([1]) Regulamentul (UE) nr. 2017/1131 al Parlamentului European și al Consiliului din 14 iunie 2017 privind fondurile de piață monetară

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.1.13)	Codul național al administratorului FPM stabilit de autoritatea competentă a FPM	
	(A.1.14)	Codul național al administratorului FPM stabilit de autoritatea competentă a administratorului FPM	
	(A.1.15)	Codul LEI al administratorului FPM	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
	(A.1.16)	Codul BCE (codul de identificare IFM) al administratorului FPM	
	(A.1.17)	Numele administratorului FPM	
	(A.1.18)	Țara în care administratorul FPM este autorizat	
	(A.1.19)	Codul LEI al depozitarului FPM	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
	(A.1.20)	Codul național al depozitarului FPM	
	(A.1.21)	Denumirea juridică a depozitarului FPM	
	(2) **Tipul de FPM**		
	(A.2.1)	Tipul de FPM [selectați o singură opțiune]	FPM pe termen scurt cu VAN variabilă FPM pe termen scurt cu VAN constantă pentru datoria publică FPM pe termen scurt cu VAN cu volatilitate scăzută FPM standard cu VAN variabilă
	(3) **Alte caracteristici ale FPM**		
	(a) *Informații despre master/feeder* (FPM care este comercializat exclusiv prin intermediul sistemului de economii destinat angajaților, potrivit legislației naționale, și are drept investitori persoane fizice)		
	(A.3.1)	În cazul în care FPM îndeplinește condițiile prevăzute la articolul 16 alineatul (5) din Regulamentul (UE) 2017/1131, se indică dacă FPM este un fond de tip „master” sau un fond de tip „feeder” [selectați o singură opțiune]	Master Feeder
	În cazul în care FPM este un fond de tip „feeder”:		
	(A.3.2)	Codul LEI al fondului „master” al FPM	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice

Post	Tip de date	Date raportate
(A.3.3)	Codul național al fondului „master” al FPM	
(A.3.4)	Denumirea juridică a fondului „master” al FPM	
(b) *Informații privind clasele de acțiuni*		
(A.3.5)	Se indică dacă FPM are clase de acțiuni	(Da/Nu)
(A.3.6)	În cazul în care FPM are clase de acțiuni, se precizează codul ISIN unic al fiecărei clase de acțiuni	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
(A.3.7)	În cazul în care FPM are clase de acțiuni, se precizează moneda fiecărei clase de acțiuni	Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice
(c) *Informații privind fondul precedent sau lichidarea (raportare unică)*		
În cazul în care FPM a fuzionat cu un alt fond, vă rugăm să indicați:		
(A.3.8)	Data fuziunii.	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
În cazul în care FPM este lichidat, vă rugăm să indicați:		
(A.3.9)	Data lichidării.	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
(4) **Indicatorii portofoliului FPM**		
(a) *Valoarea totală a activelor (în sensul modelului de raportare conform Regulamentului privind FPM, se consideră că valoarea totală a activelor este egală cu VAN – a se vedea câmpul de mai jos A.4.1)*		
(b) *Valoarea activului net (VAN) (la nivel de subfond – nu la nivelul claselor de acțiuni)*		
(A.4.1)	Valoarea activului net al FPM (la nivel de subfond)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.4.2)	Valoarea activului net al FPM	(în moneda de bază)
(c) *Scadența medie ponderată (WAM)*		
(A.4.3)	Scadența medie ponderată a FPM, calculată astfel cum se prevede la articolul 2 alineatul (19) din Regulamentul (UE) 2017/1131.	(zile)

Post		Tip de date	Date raportate
	(d) *Durata de viață medie ponderată (WAL)*		
	(A.4.4)	Durata de viață medie ponderată a FPM, calculată astfel cum se prevede la articolul 2 alineatul (20), la articolul 24 alineatul (1) litera (b) și la articolul 25 alineatul (1) litera (b) din Regulamentul (UE) 2017/1131.	(zile)
	(e) *Indicatorii de lichiditate*		
	Profilul de lichiditate al portofoliului		
	(A.4.5)	% din active care se califică pentru rezerva de lichiditate zilnică [active cu scadență zilnică, astfel cum sunt definite la articolele 24 și 25 din Regulamentul (UE) 2017/1131]	%
	(A.4.6)	% din active care se califică pentru rezerva de lichiditate săptămânală [active cu scadență săptămânală, astfel cum sunt definite la articolele 24 și 25 din Regulamentul (UE) 2017/1131]	%
	(A.4.7)	Profilul de lichiditate al portofoliului	Procentajul din portofoliu care poate fi lichidat și care se încadrează în fiecare perioadă
Perioada	1 zi sau mai puțin ☐ 2-7 zile ☐ 8-30 de zile ☐ Peste 30 de zile ☐		
	(f) *Randamentul*		
	(A.4.8)	Randament cumulat	%
Interval	De la începutul anului ☐ 1 lună ☐ 3 luni ☐ 1 an ☐ 3 ani ☐ 5 ani ☐		
	(A.4.9)	Performanța într-un an calendaristic (randamentul net) a celei mai reprezentative clase de active	%
Interval	Anul N-1 ☐ Anul N-2 ☐ Anul N-3 ☐		
	(A.4.10)	Volatilitatea lunară a portofoliului și volatilitatea lunară a portofoliului pentru VAN la prețul pieței (*shadow NAV*) (dacă este cazul)	%
Interval	1 an ☐ 2 ani ☐ 3 ani ☐		

Post	Tip de date	Date raportate
(5) **Simulările situațiilor de criză pentru FPM**		
(a) *Rezultatele simulărilor situațiilor de criză pentru FPM*		
(A.5.1)	Rezultatele simulărilor situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește lichiditatea, care au avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.2)	Rezultatele simulărilor situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește riscul de credit, care au avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.3)	Rezultatele simulărilor situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește cursul de schimb valutar, care au avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.4)	Rezultatele simulărilor situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește rata dobânzii, care au avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.5)	Rezultatele simulării situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește nivelul de răscumpărare, care a avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.6)	Rezultatele simulării situațiilor de criză pentru FPM în ceea ce privește marja dintre indicii de care sunt legate ratele dobânzii aferente titlurilor de valoare din portofoliu, care a avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
(A.5.7)	Rezultatele simulării situațiilor de criză pentru FPM la nivel macrosistemic, care a avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.5.8)	Rezultatele simulării situațiilor de criză multivariabile pentru FPM, care a avut loc în perioada de raportare, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și în Ghidul ESMA corespunzător privind scenariile de simulare a situațiilor de criză	
	(A.5.9)	În cazul FPM cu VAN constantă și al FPM cu VAN cu volatilitate scăzută, indicați rezultatele simulărilor situațiilor de criză menționate în câmpurile de la A.5.1 la A.5.8 ca diferența dintre VAN constantă pe unitate sau pe acțiune și VAN pe unitate sau pe acțiune	
	(b) *Planul de acțiune propus (dacă este cazul)*		
	(A.5.10)	Indicați planul de acțiune propus, astfel cum este prevăzut la articolul 28 alineatul (4) din Regulamentul (UE) 2017/1131	Text liber
	(6) **Informații privind activele deținute în portofoliul FPM**		
	(a) *Instrumentele de piață monetară, securitizările eligibile și efectele de comerț garantate cu active*		
	Câmpurile A.6 de mai jos se completează folosind un formular de raportare, element cu element		
	(A.6.1)	Tipul de instrument al pieței monetare, de securitizări eligibile și de efecte de comerț garantate cu active [selectați una sau mai multe opțiuni]	
		Indicați tipul de instrumente ale pieței monetare, de securitizări eligibile și de efecte de comerț garantate cu active	Instrumente ale pieței monetare prevăzute la articolul 10 din Regulamentul (UE) 2017/1131 Securitizări menționate la articolul 13 din Regulamentul delegat (UE) 2015/61 al Comisiei [2] ABCP, astfel cum se menționează la articolul 11 alineatul (1) litera (b) din Regulamentul (UE) 2017/1131 O securitizare simplă, transparentă și standardizată sau un ABCP, astfel cum se menționează la articolul 11 alineatul (1) litera (c) din Regulamentul (UE) 2017/1131
		În cazul în care tipul de activ este un instrument al pieței monetare, completați câmpurile de la A.6.2 până la A.6.20	
	(A.6.2)	Descrierea instrumentului pieței monetare	
	(A.6.3)	Codul ISIN al instrumentului pieței monetare	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice

[2] Regulamentul delegat (UE) 2015/61 al Comisiei din 10 octombrie 2014 de completare a Regulamentului (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului în ceea ce privește cerința de acoperire a necesarului de lichiditate pentru instituțiile de credit (JO L 11, 17.1.2015, p. 1).

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.6.4)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al instrumentului pieței monetare	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
	(A.6.5)	Codul LEI al emitentului	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
	(A.6.6)	Denumirea emitentului	
	(A.6.7)	Categoria emitentului Selectați categoria corespunzătoare a emitentului [selectați o singură opțiune]	Entitate suverană (UE) Entitate suverană (din afara UE) Bancă centrală din UE Bancă centrală din afara UE Administrație regională Administrație locală Organism public național Organism public al UE (cu excepția unui organism public național) Organism public din afara UE Organism public supranațional (UE) Organism public supranațional (altul decât cele ale UE) Instituție de credit Alte societăți financiare Societăți nefinanciare
	(A.6.8)	Țara emitentului instrumentului pieței monetare	ISO 3166 – codul țării
	(A.6.9)	Data scadenței instrumentului pieței monetare	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(A.6.10)	Moneda instrumentului pieței monetare	(Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice)
	(A.6.11)	Cantitatea instrumentului pieței monetare	
	(A.6.12)	Prețul net al instrumentului pieței monetare	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.13)	Prețul net al instrumentului pieței monetare	(în moneda de bază)
	(A.6.14)	Dobânzi acumulate	

Post	Tip de date	Date raportate
(A.6.15)	Dobânzi acumulate	(în moneda de bază, dacă A.6.14 este în EUR)
(A.6.16)	Valoarea totală de piață a instrumentului pieței monetare	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.17)	Valoarea totală de piață a instrumentului pieței monetare	(în moneda de bază)
(A.6.18)	Metoda utilizată pentru stabilirea prețului instrumentului pieței monetare	raportarea la piață raportarea la model costul amortizat
(A.6.19)	Indicați dacă rezultatul procedurii de evaluare internă a creditului este favorabil sau nefavorabil	(favorabil/nefavorabil)
(A.6.20)	Precizați următoarea dată de revizuire a ratei dobânzii [astfel cum se menționează la articolul 10 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2017/1131]	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	În cazul în care tipul de activ este o securitizare eligibilă sau un efect de comerț garantat cu active eligibil, completați câmpurile de la A.6.21 până la A.6.37	
(A.6.21)	Descrierea securitizării eligibile sau a efectului de comerț garantat cu active eligibil	
(A.6.22)	Codul ISIN al securitizării eligibile sau al efectului de comerț garantat cu active eligibil	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
(A.6.23)	Țara sponsorului securitizării eligibile și al efectului de comerț garantat cu active eligibil	ISO 3166 – codul țării
(A.6.24)	Codul LEI al sponsorului	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
(A.6.25)	Denumirea sponsorului	
(A.6.26)	Tipul de activ-suport	Creanțe comerciale Credite de consum Leasing Creanțe aferente cărților de credit Credite către societăți sau IMM-uri Ipoteci rezidențiale Ipoteci comerciale Alte active

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.6.27)	Data scadenței	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(A.6.28)	Moneda	(Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice)
	(A.6.29)	Cantitatea	
	(A.6.30)	Prețul net	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.31)	Prețul net	(în moneda de bază)
	(A.6.32)	Dobânzi acumulate	
	(A.6.33)	Dobânzi acumulate	(în moneda de bază, dacă A.6.30 este în EUR)
	(A.6.34)	Valoarea totală de piață	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.35)	Valoarea totală de piață	(în moneda de bază)
	(A.6.36)	Metoda utilizată pentru stabilirea prețului securitizării eligibile sau al efectului de comerț garantat cu active eligibil	raportarea la piață raportarea la model costul amortizat
	(A.6.37)	Indicați dacă rezultatul procedurii de evaluare internă a creditului este favorabil sau nefavorabil	(favorabil/nefavorabil)
	(b) *Alte active*		
	(A.6.38)	Tipul de alte active [selectați o singură opțiune] Tipul de alte active se selectează dintre activele enumerate la articolul 9 din Regulamentul (UE) 2017/1131	Depozite pe lângă instituții de credit, astfel cum se menționează la articolul 12 din Regulamentul (UE) 2017/1131 Acorduri reverse repo, astfel cum se menționează la articolul 15 din Regulamentul (UE) 2017/1131 Acorduri repo, astfel cum se menționează la articolul 14 din Regulamentul (UE) 2017/1131 Unități sau acțiuni ale altor FPM, astfel cum se menționează la articolul 16 din Regulamentul (UE) 2017/1131

Post		Tip de date	Date raportate
			Instrumente financiare derivate, astfel cum se menționează la articolul 13 din Regulamentul (UE) 2017/1131 din care: — Instrumente financiare derivate tranzacționate pe o piață reglementată (și specificați dacă fac obiectul articolului 50 alineatul (1) literele (a), (b) sau (c) din Directiva 2009/65/CE) — Instrumente financiare derivate tranzacționate în afara piețelor reglementate (OTC) Alte active lichide [în conformitate cu articolul 50 alineatul (2) din Directiva 2009/65/CE]
		În cazul în care tipul de alt activ este un instrument financiar derivat, completați câmpurile de la A.6.39 până la A.6.60	
	(A.6.39)	Tipul de contract derivat	
	(A.6.40)	Codul ISIN al instrumentului financiar derivat	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
	(A.6.41)	Codul UPI al instrumentului financiar derivat (în cazul în care codul ISIN nu este disponibil)	
	(A.6.42)	Codul FISN (denumirea scurtă a instrumentului financiar) al instrumentului financiar derivat	ISO 18774
	(A.6.43)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al instrumentului financiar derivat	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
	(A.6.44)	Tipul de instrument derivat prevăzut la articolul 13 litera (a) din Regulamentul (UE) 2017/1131 [selectați o singură opțiune]	rata dobânzii monede indici de rate ale dobânzii indici de monede
	(A.6.45)	Denumirea activului-suport	
	(A.6.46)	Tipul de identificare a activului-suport ([3])	I = ISIN X = indice

([3]) Identificarea instrumentelor derivate în EMIR

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.6.47)	Identificarea activului-suport	Pentru identificatorul activului-suport de tipul I: Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice Pentru identificatorul activului-suport de tipul X: Codul ISIN ISO 6166, 12 caractere alfanumerice, dacă există, în caz contrar denumirea completă a indicelui, astfel cum a fost atribuită de furnizorul acestuia
	(A.6.48)	Moneda noțională 1 ([4])	Codul ISO 4217 al monedei
	(A.6.49)	Moneda noțională 2 ([5])	Codul ISO 4217 al monedei
	(A.6.50)	Țara instrumentului financiar derivat	ISO 3166 – codul țării
	(A.6.51)	Data scadenței instrumentului financiar derivat	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(A.6.52)	Expunerea instrumentului financiar derivat	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.53)	Expunerea instrumentului financiar derivat	(în moneda de bază)
	(A.6.54)	Valoarea de piață a instrumentului financiar derivat	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.55)	Valoarea de piață a instrumentului financiar derivat	(în moneda de bază)
	(A.6.56)	Valoarea de piață a garanțiilor reale primite (în ceea ce privește instrumentul financiar derivat)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.57)	Valoarea de piață a garanțiilor reale primite (în ceea ce privește instrumentul financiar derivat)	(în moneda de bază)
	(A.6.58)	Precizați următoarea dată de revizuire a ratei dobânzii [astfel cum se menționează la articolul 10 alineatul (2) din Regulamentul (UE) 2017/1131]	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(A.6.59)	Denumirea contrapărții	
	(A.6.60)	Codul LEI al contrapărții	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice

([4]) Moneda în care este exprimată valoarea noțională. În cazul unui contract derivat pe rata dobânzii, aceasta va fi moneda noțională a segmentului 1.
([5]) Moneda în care este exprimată valoarea noțională. În cazul unui contract derivat pe rata dobânzii, aceasta va fi moneda noțională a segmentului 2.

Post	Tip de date	Date raportate
	În cazul în care tipul de alt activ este o unitate sau acțiune a altui FPM, completați câmpurile de la A.6.61 până la A.6.71	
(A.6.61)	Descrierea unității sau acțiunii altui FPM	
(A.6.62)	Codul ISIN al unității sau acțiunii altui FPM	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
(A.6.63)	Codul LEI (în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al unității sau acțiunii altui FPM	
(A.6.64)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al unității sau acțiunii altui FPM	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
(A.6.65)	Moneda	(Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice)
(A.6.66)	Țara unității sau acțiunii altui FPM	ISO 3166 – codul țării
(A.6.67)	Valoarea de piață a unității sau acțiunii altui FPM	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.68)	Valoarea de piață a unității sau acțiunii altui FPM	(în moneda de bază)
(A.6.69)	Cantitatea	
(A.6.70)	Prețul pe unitatea sau acțiunea altui FPM (VAN pe unitatea sau acțiunea altui FPM)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.71)	Prețul pe unitatea sau acțiunea altui FPM (VAN pe unitatea sau acțiunea altui FPM)	(în moneda de bază)
	În cazul în care tipul de alt activ este un depozit sau alte active lichide, completați câmpurile de la A.6.72 până la A.6.81	
(A.6.72)	Descrierea depozitului sau a altor active lichide	
(A.6.73)	Codul ISIN al depozitului sau al altor active lichide	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
(A.6.74)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al depozitului sau al altor active lichide	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
(A.6.75)	Țara depozitului sau a altor active lichide	ISO 3166 – codul țării

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.6.76)	Denumirea contrapărții	
	(A.6.77)	Codul LEI al contrapărții	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
	(A.6.78)	Data scadenței depozitului sau a altor active lichide	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(A.6.79)	Moneda	(Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice)
	(A.6.80)	Expunerea depozitului sau a altor active lichide	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(A.6.81)	Expunerea depozitului sau a altor active lichide	(în moneda de bază)
		În cazul în care tipul de alt activ este un acord repo sau un acord reverse repo, completați câmpurile de la A.6.82 până la A.6.99	
	(A.6.82)	Descrierea acordului repo sau a acordului reverse repo	
	(A.6.83)	Codul ISIN al acordului repo sau al acordului reverse repo	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
	(A.6.84)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al acordului repo sau al acordului reverse repo	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
	(A.6.85)	Țara acordului repo sau a acordului reverse repo	ISO 3166 – codul țării
	(A.6.86)	Categoria contrapărții Categoriile contrapărții se selectează dintre următoarele [a se vedea articolul 20 alineatul (2) litera (e) din Regulamentul (UE) 2017/1131] [selectați o singură opțiune]	Entitate suverană (UE) Entitate suverană (din afara UE) Bancă centrală din UE Bancă centrală din afara UE Administrație regională Administrație locală Organism public național Organism public al UE (cu excepția unui organism public național) Organism public din afara UE Organism public supranațional (UE) Organism public supranațional (altul decât cele ale UE)

Post	Tip de date	Date raportate
		Instituție de credit Alte societăți financiare Societăți nefinanciare
(A.6.87)	Codul LEI al contrapărții	Codul LEI în conformitate cu ISO 17442, compus din 20 de caractere alfanumerice
(A.6.88)	Denumirea contrapărții	
(A.6.89)	Data scadenței acordului repo sau a acordului reverse repo	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
(A.6.90)	Moneda	(Codul monedei în format ISO 4217, 3 caractere alfabetice)
(A.6.91)	Expunerea acordului repo sau a acordului reverse repo (în cazul unui acord reverse repo, aceasta este valoarea numerarului furnizat contrapărții)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.92)	Expunerea acordului repo sau a acordului reverse repo (în cazul unui acord reverse repo, aceasta este valoarea numerarului furnizat contrapărții)	(în moneda de bază)
(A.6.93)	Valoarea de piață a garanțiilor reale primite (în ceea ce privește acordul repo sau acordul reverse repo) (suma în numerar primită de FPM ca parte a acordurilor repo [astfel cum se menționează la articolul 14 litera (d) din Regulamentul (UE) 2017/1131]	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.94)	Valoarea de piață a garanțiilor reale primite (în ceea ce privește acordul repo sau acordul reverse repo) (suma în numerar primită de FPM ca parte a acordurilor repo [astfel cum se menționează la articolul 14 litera (d) din Regulamentul (UE) 2017/1131]	(în moneda de bază)
(A.6.95)	Indicați dacă rezultatul procedurii de evaluare internă a creditului este favorabil sau nefavorabil [pentru diferitele valori mobiliare lichide sau (alte) instrumente ale pieței monetare primite ca parte a unui acord reverse repo, astfel cum se menționează la articolul 15 alineatul (6) din Regulamentul (UE) 2017/1131] [6]	(favorabil/nefavorabil)

[6] În cazul în care FPM primește diferite active ca garanții reale în sensul articolului 15 alineatul (6) din Regulamentul (UE) 2017/1131, rezultatele trebuie raportate pentru fiecare activ.

Post	Tip de date	Date raportate
În cazul acordurilor reverse repo și al activelor menționate la articolul 15 din Regulamentul (UE) 2017/1131 care au fost primite de FPM, vă rugăm să indicați:		
(A.6.96)	Codul ISIN al acestor active diferite	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
(A.6.97)	Valoarea de piață a acestor active diferite	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
(A.6.98)	Valoarea de piață a acestor active diferite	(în moneda de bază)
(A.6.99)	În cazul acordurilor reverse repo, indicați dacă există active menționate la articolul 15 alineatul (6) din Regulamentul (UE) 2017/1131 care au fost primite de FPM	(Da/Nu)
(7) **Informații privind pasivele FPM**		
(a) *Informații privind investitorii – concentrarea investitorilor*		
(A.7.1)	Precizați procentajul aproximativ din capitalurile proprii ale FPM deținut de cei cinci beneficiari reali care au cele mai mari participații în FPM, ca procentaj din VAN a FPM. Se aplică abordarea de tip „look-through" până când se ajunge la beneficiarii reali finali, în cazul în care aceștia sunt cunoscuți sau pot fi cunoscuți	% (din VAN)
(b) *Informații privind investitorii – defalcarea concentrării investitorilor*		
(A.7.2)	Indicați defalcarea concentrării investitorilor în funcție de statutul acestora (a se folosi estimări în cazul în care nu sunt disponibile informații exacte): 1) Clienți profesionali [astfel cum sunt definiți la articolul 4 alineatul (1) punctul 10 of Directiva 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului [7] (MiFID 2)] 2) clienți de retail [astfel cum sunt definiți la articolul 4 alineatul (1) punctul 11 din Directiva 2014/65/UE (MiFID 2)]	
	— Clienți profesionali [astfel cum sunt definiți la articolul 4 alineatul (1) punctul 10 din Directiva 2014/65/UE (MiFID 2)]	% (din VAN)
	— Clienți de retail [astfel cum sunt definiți la articolul 4 alineatul (1) punctul 11 din Directiva 2014/65/UE (MiFID 2)]	% (din VAN)

[7] Directiva 2014/65/UE a Parlamentului European și a Consiliului din 15 mai 2014 privind piețele instrumentelor financiare și de modificare a Directivei 2002/92/CE și a Directivei 2011/61/UE

Post	Tip de date	Date raportate
(c) *Informații privind investitorii – repartizarea geografică*		
(A.7.3)	Furnizați defalcarea deținătorilor de unități/acțiuni în FPM pe grupuri de investitori. Se aplică abordarea de tip „look-through” până când se ajunge la beneficiarii reali finali, în cazul în care aceștia sunt cunoscuți sau pot fi cunoscuți.	(% din VAN) Societăți nefinanciare Bănci Societăți de asigurare Alte instituții financiare Planuri/fonduri de pensii Administrații publice Alte organisme de plasament colectiv Gospodării Necunoscut
(A.7.4)	Indicați repartizarea geografică a investitorilor în funcție de țară (a se folosi estimări în cazul în care nu sunt disponibile informații exacte)	
	Țara	(% din VAN, Țara – ISO 3166 – 2 caractere)
(d) *Informații privind investitorii – activitatea de subscriere și de răscumpărare*		
Răscumpărările realizate de investitori		
(A.7.5)	Indicați frecvența răscumpărărilor realizate de investitori. În cazul mai multor clase de acțiuni sau de unități, raportați clasa cea mai mare de acțiuni sau de unități în funcție de VAN. [Selectați o singură opțiune]	Zilnic Săptămânal Lunar Bilunar Alta Niciun drept de răscumpărare
(A.7.6)	Care este perioada de preaviz solicitată investitorilor pentru răscumpărări, în zile?	Zile
(A.7.7)	La data raportării, ce procentaj din VAN al FPM este supus următoarelor măsuri:	
	Limite de răscumpărare	% din VAN

Post		Tip de date	Date raportate
		Suspendarea tranzacționării	% din VAN
		Comisioane de lichiditate	% din VAN
		Alte măsuri de administrare a activelor nelichide	Tip de măsură
			% din VAN
	(A.7.8)	Valoarea activului net al FPM pe parcursul perioadei de raportare	(în EUR, incluzând impactul subscrierilor și al răscumpărărilor) (în ultima zi a lunii)
		Ianuarie	
		Februarie	
		Martie	
		Aprilie	
		Mai	
		Iunie	
		Iulie	
		August	
		Septembrie	
		Octombrie	
		Noiembrie	
		Decembrie	
	(A.7.9)	Subscrieri în decursul perioadei de raportare	(în EUR)
		Ianuarie	
		Februarie	
		Martie	
		Aprilie	

Post		Tip de date	Date raportate
		Mai	
		Iunie	
		Iulie	
		August	
		Septembrie	
		Octombrie	
		Noiembrie	
		Decembrie	
	(A.7.10)	Răscumpărări în decursul perioadei de raportare	(în EUR)
		Ianuarie	
		Februarie	
		Martie	
		Aprilie	
		Mai	
		Iunie	
		Iulie	
		August	
		Septembrie	
		Octombrie	
		Noiembrie	
		Decembrie	

Post		Tip de date	Date raportate
	(A.7.11)	Plăți către investitori	(în EUR)
		Ianuarie	
		Februarie	
		Martie	
		Aprilie	
		Mai	
		Iunie	
		Iulie	
		August	
		Septembrie	
		Octombrie	
		Noiembrie	
		Decembrie	
	(A.7.12)	Cursul de schimb	
		Ianuarie	
		Februarie	
		Martie	
		Aprilie	
		Mai	
		Iunie	
		Iulie	
		August	

Post		Tip de date	Date raportate
		Septembrie	
		Octombrie	
		Noiembrie	
		Decembrie	

FPM cu VAN cu volatilitate scăzută

	Post	Tip de date	Date raportate
(B) Se aplică FPM cu VAN cu volatilitate scăzută			
		(a) Indicați fiecare eveniment în care prețul unui activ evaluat folosind metoda costului amortizat în conformitate cu articolul 29 alineatul (7) primul paragraf din Regulamentul (UE) 2017/1131 deviază de la prețul respectivului activ calculat în conformitate cu articolul 29 alineatele (2), (3) și (4) din Regulamentul (UE) 2017/1131 cu mai mult de 10 puncte de bază. Aceste câmpuri trebuie raportate pentru fiecare activ al căror preț calculat folosind metoda costului amortizat prezintă o astfel de deviere.	
	(B.1.1)	Data evaluării (prima zi în care are loc evenimentul)	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(B.1.2)	Codul ISIN al activului	Codul ISIN ISO 6166, compus din 12 caractere alfanumerice
	(B.1.3)	Codul CFI (dacă este disponibil și în cazul în care codul ISIN nu este disponibil) al activului	Codul CFI ISO 10692, compus din 6 caractere alfabetice
	(B.1.4)	Prețul [articolul 29 alineatele (2), (3) și (4) din Regulamentul (UE) 2017/1131] (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.1., la care are loc evenimentul)	
	(B.1.5)	Prețul (metoda costului amortizat) (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.1., la care are loc evenimentul)	
	(B.1.6)	De la data evaluării menționată în câmpul B.1.1, precizați cât timp prețul unui activ evaluat folosind metoda costului amortizat a deviat cu peste 10 puncte de bază față de prețul respectivului activ	(zile)
	(B.1.7)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.6, precizați diferența medie dintre cele două valori menționate în câmpul B.1.6	

	Post	Tip de date	Date raportate
	(B.1.8)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.6, precizați devierea minimă a prețului dintre cele două valori	
	(B.1.9)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.6, precizați devierea maximă a prețului dintre cele două valori	
		(b) Indicați fiecare eveniment în care VAN constantă pe unitate sau pe acțiune calculată în conformitate cu articolul 32 alineatele (1) și (2) din Regulamentul (UE) 2017/1131 deviază de la VAN pe unitate sau pe acțiune calculată în conformitate cu articolul 30 din Regulamentul (UE) 2017/1131 cu mai mult de 20 de puncte de bază.	
	(B.1.10)	Data evaluării (prima zi în care are loc evenimentul)	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(B.1.11)	VAN constantă [articolul 31 din Regulamentul (UE) 2017/1131] (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.10., la care are loc evenimentul)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(B.1.12)	VAN constantă [articolul 31 din Regulamentul (UE) 2017/1131] (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.10., la care are loc evenimentul)	(în moneda de bază)
	(B.1.13)	VAN [articolul 30 din Regulamentul (UE) 2017/1131] (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.10., la care are loc evenimentul)	(în EUR) (în cazul în care moneda de bază nu este EUR, rata de schimb utilizată este cursul cel mai recent stabilit de Banca Centrală Europeană)
	(B.1.14)	VAN [articolul 30 din Regulamentul (UE) 2017/1131] (la data evaluării, menționată în câmpul B.1.10., la care are loc evenimentul)	(în moneda de bază)
	(B.1.15)	De la data evaluării specificată în câmpul B.1.10, precizați cât timp VAN constantă pe unitate sau pe acțiune calculată a deviat de la VAN pe unitate sau pe acțiune calculată cu mai mult de 20 de puncte de bază	(zile)
	(B.1.16)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.15, precizați diferența medie dintre cele două valori menționate în câmpul B.1.15	
	(B.1.17)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.15, precizați devierea minimă a prețului dintre cele două valori	
	(B.1.18)	În cursul perioadei menționate în câmpul B.1.15, precizați devierea maximă a prețului dintre cele două valori	
		(c) Indicați fiecare eveniment în care are loc o situație menționată la articolul 34 alineatul (3) din Regulamentul (UE) 2017/1131 și măsurile luate de consiliul de administrație în conformitate cu articolul 34 alineatul (1) literele (a) și (b) din regulamentul respectiv.	
	(B.1.19)	Data evenimentului	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ

	Post	Tip de date	Date raportate
	(B.1.20)	Data la care a fost luată măsura	Data în formatul ISO 8601, AAAA-LL-ZZ
	(B.1.21)	Tipul măsurii (ori de câte ori ponderea activelor cu scadență săptămânală scade sub 30 % din totalul activelor FPM și ori de câte ori răscumpărările zilnice nete dintr-o singură zi lucrătoare depășesc 10 % din totalul activelor)	comisioane de lichiditate pentru răscumpărări limite de răscumpărare suspendarea răscumpărărilor nicio acțiune imediată în afară de corectarea situației în care sunt depășite limitele menționate la articolul 24 alineatul (1) din Regulamentul (UE) 2017/1131, în conformitate cu articolul 24 alineatul (2) din regulamentul respectiv
	(B.1.22)	Tipul măsurii (ori de câte ori ponderea activelor cu scadență săptămânală scade sub 10 % din totalul activelor)	comisioane de lichiditate pentru răscumpărări suspendarea răscumpărărilor