

РЕГЛАМЕНТ ЗА ИЗПЪЛНЕНИЕ (ЕС) 2018/708 НА КОМИСИЯТА**от 17 април 2018 година**

за определяне на технически стандарти за изпълнение по отношение на образца, който трябва да се използва от лицата, управляващи фондове на паричния пазар, когато докладват пред компетентните органи по силата на член 37 от Регламент (ЕС) 2017/1131 на Европейския парламент и на Съвета

(текст от значение за ЕИП)

ЕВРОПЕЙСКАТА КОМИСИЯ,

като взе предвид Договора за функционирането на Европейския съюз,

като взе предвид Регламент (ЕС) 2017/1131 на Европейския парламент и на Съвета от 14 юни 2017 г. относно фондовете на паричния пазар ⁽¹⁾, и по-специално член 37, параграф 4 от него,

като има предвид, че:

- (1) Наред с изискванията за докладване, определени в директиви 2009/65/ЕО ⁽²⁾ и 2011/61/ЕС ⁽³⁾ на Европейския парламент и на Съвета, са необходими допълнителни изисквания за докладване, за да се гарантира, че компетентните органи са в състояние да откриват, наблюдават и реагират ефективно на рискове на пазара на фондове на паричния пазар (ФПП).
- (2) В член 37 от Регламент (ЕС) 2017/1131 се изисква ФПП да предоставят на своите компетентни органи подробен списък с данни. С цел в целия Европейски съюз да се осигури съгласуваност на начина на събиране на такива данни от посочените органи и да се гарантира, че посочените органи са информирани за основните промени на пазара на ФПП и могат да улесняват колективния анализ на потенциалните въздействия на пазара на ФПП в Съюза, информацията трябва да бъде предоставяна на компетентните органи по еднакъв начин в целия ЕС. Освен това използването на стандартен образец за докладване улеснява извършването на процедурите и процесите, свързани с изискванията към ФПП за докладване, и свежда до минимум свързаните с това разходи.
- (3) С цел да се осигури ефективен надзор в Съюза, тези данни следва да се препращат на Европейския орган за ценни книжа и пазари (ЕОЦКП), така че да бъде създадена централна база данни за ФПП.
- (4) Настоящият регламент е изготвен въз основа на проектите на технически стандарти за изпълнение, предадени на Комисията от ЕОЦКП.
- (5) ЕОЦКП проведе открита обществена консултация по проектите на техническите стандарти за изпълнение, въз основа на които е изготвен настоящият регламент, анализира потенциалните разходи и ползи и поиска становище от създадената с член 37 от Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета Група на участниците от сектора на ценните книжа и пазарите ⁽⁴⁾.
- (6) Началната дата на прилагане на настоящия регламент за изпълнение следва да се приведе в съответствие с началната дата на прилагане на Регламент (ЕС) 2017/1131, за да се даде възможност на националните органи да събират информацията, която трябва да предават в базата данни на ЕОЦКП, посочена в член 37, параграф 5 от Регламент (ЕС) 2017/1131,

ПРИЕ НАСТОЯЩИЯ РЕГЛАМЕНТ:

Член 1

Лицата, управляващи фондове на паричния пазар (ФПП), използват образца, съдържащ се в приложението към настоящия регламент, когато докладват пред компетентния орган на даден ФПП, както е предвидено в член 37 от Регламент (ЕС) 2017/1131.

⁽¹⁾ ОВ L 169, 30.6.2017 г., стр. 8.

⁽²⁾ Директива 2009/65/ЕО на Европейския парламент и на Съвета от 13 юли 2009 г. относно координирането на законовите, подзаконовите и административните разпоредби относно предприятията за колективно инвестиране в прехвърлими ценни книжа (ПКИПЦК) (преработена версия) (ОВ L 302, 17.11.2009 г., стр. 32).

⁽³⁾ Директива 2011/61/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 8 юни 2011 г. относно лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове, и за изменение на директиви 2003/41/ЕО и 2009/65/ЕО и на регламенти (ЕО) № 1060/2009 и (ЕС) № 1095/2010 (ОВ L 174, 1.7.2011 г., стр. 1).

⁽⁴⁾ Регламент (ЕС) № 1095/2010 на Европейския парламент и на Съвета от 24 ноември 2010 г. за създаване на Европейски надзорен орган (Европейски орган за ценни книжа и пазари), за изменение на Решение № 716/2009/ЕО и за отмяна на Решение 2009/77/ЕО на Комисията (ОВ L 331, 15.12.2010 г., стр. 84).

Член 2

Настоящият регламент влиза в сила на двадесетия ден след деня на публикуването му в *Официален вестник на Европейския съюз*.

Той се прилага от 21 юли 2018 г.

Настоящият регламент е задължителен в своята цялост и се прилага пряко във всички държави членки.

Съставено в Брюксел на 17 април 2018 година.

За Комисията
Председател
Jean-Claude JUNCKER

ПРИЛОЖЕНИЕ

Образец за докладване за лицата, управляващи фондове на паричния пазар (ФПП)

Освен ако е посочено друго, всички данни се попълват на равнище подфондове

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(А) Приложимо за всички ФПП		
(1) Общи характеристики, идентификация на ФПП или на лицето, управляващо ФПП		
(А.1.1)	Отчетен период	
(А.1.2)	Национален код на ФПП, предоставен от компетентния орган на ФПП	
(А.1.3)	ИКПС на ФПП	Идентификационен код на правен субект (ИКПС) по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(А.1.4)	Код на ЕЦБ (идентификационен код на парично-финансовата институция – ПФИ) на ФПП	
(А.1.5)	Наименование на ФПП	
(А.1.6)	Посочете дали даден ФПП е ПКИПЦК или АИФ	ПКИПЦК АИФ
(А.1.7)	Посочете дали ФПП се предлага на пазара единствено посредством спестовни схеми за работници и служители, които са уредени в националното право и чиито инвеститори са само физически лица (в съответствие с член 16, параграф 5 от Регламент (ЕС) 2017/1131 ⁽¹⁾)	(да/не)
(А.1.8)	Място на установяване на ФПП	Код на държавата по ISO 3166
(А.1.9)	Държавата членка, в която ФПП е получил разрешение	Код на държавата по ISO 3166
(А.1.10)	Държави членки, в които ФПП се предлага на пазара	Списък на държавите (кодове на държавите по ISO 3166)
(А.1.11)	Дата на създаване на ФПП	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(А.1.12)	Основна валута на ФПП	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака

⁽¹⁾ Регламент (ЕС) 2017/1131 на Европейския парламент и на Съвета от 14 юни 2017 г. относно фондовете на паричния пазар

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.1.13)	Национален код на лицето, управляващо ФПП, предоставен от компетентния орган на ФПП	
(A.1.14)	Национален код на лицето, управляващо ФПП, предоставен от компетентния орган на лицето, управляващо ФПП	
(A.1.15)	ИКПС на лицето, управляващо ФПП	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.1.16)	Код на ЕЦБ (идентификационен код на ПФИ) на лицето, управляващо ФПП	
(A.1.17)	Име/фирма на лицето, управляващо ФПП	
(A.1.18)	Държава, в която лицето, управляващо ФПП е получило разрешение	
(A.1.19)	ИКПС на депозитаря на ФПП	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.1.20)	Национален код на депозитаря на ФПП	
(A.1.21)	Официално наименование на депозитаря на ФПП	
(2) Вид на ФПП		
(A.2.1)	Вид на ФПП [изберете един вид]	Краткосрочен ФПП с променлива НСА ФПП с постоянна НСА, инвестиращ в държавни дългови инструменти Краткосрочен ФПП със слабо променлива НСА Стандартен ФПП с променлива НСА
(3) Други характеристики на ФПП		
а) <i>Информация дали фондът е главен или хранващ</i> (ФПП, предлагани на пазара единствено посредством спестовни схеми за работници и служители, които са уредени в националното право и чиито инвеститори са само физически лица)		
(A.3.1)	Ако ФПП съответства на условията по член 16, параграф 5 от Регламент (ЕС) 2017/1131, се посочва дали той е главен или хранващ [изберете един вариант]	Главен Хранващ
Ако ФПП е хранващ:		
(A.3.2)	ИКПС на главния фонд на този ФПП	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.3.3)	Национален код на главния фонд на този ФПП	
(A.3.4)	Официално наименование на главния фонд на ФПП	
б) Информация за класовете акции		
(A.3.5)	Посочете дали ФПП има класове акции	(да/не)
(A.3.6)	Когато ФПП има класове акции, посочете единния ISIN код на отделните класове акции	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(A.3.7)	Когато ФПП има класове акции, посочете валутата на отделните класове акции	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
в) Информация за предходен фонд или ликвидация (еднократно докладване)		
Ако ФПП е бил слят с друг фонд, моля посочете:		
(A.3.8)	Дата на сливането.	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
Ако ФПП е в процес на ликвидация, моля посочете:		
(A.3.9)	Дата на ликвидацията.	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(4) Показатели на портфейла на ФПП		
а) Обща стойност на активите (за целите на образеца за докладване по Регламента за ФПП се приема, че общата стойност на активите е равна на НСА — вж. по-долу в поле A.4.1)		
б) НСА (на равнище подфонд, а не клас акции)		
(A.4.1)	Нетната стойност на активите на ФПП (на равнище подфонд)	(EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.4.2)	Нетната стойност на активите на ФПП	(в основната валута)
в) Среднопретеглен срок до падежа (СПСП)		
(A.4.3)	Среднопретеглен срок до падежа на ФПП, изчислен съгласно определеното в член 2, точка 19 от Регламент (ЕС) 2017/1131.	(дни)

Статия	Вид данни	Докладвани данни
	г) Среднопретеглена продължителност (СПП)	
(A.4.4)	Среднопретеглена продължителност на ФПП, изчислена съгласно определеното в член 2, точка 20, член 24, параграф 1, буква б), член 25, параграф 1, буква б) от Регламент (ЕС) 2017/1131.	(дни)
	д) Показатели за ликвидност	
	Профил на ликвидността на портфейла	
(A.4.5)	% на активите, отговарящи на изискванията за дневен ликвиден буфер (активите с дневен падеж, определени в членове 24 и 25 от Регламент (ЕС) 2017/1131)	%
(A.4.6)	% на активите, отговарящи на изискванията за седмичен ликвиден буфер (активите със седмичен падеж, определени в членове 24 и 25 от Регламент (ЕС) 2017/1131)	%
(A.4.7)	Профил на ликвидността на портфейла	Процентен дял от портфейла, който може да бъде осребрен, за всеки съответен период
Период	1 ден или по-малко <input type="text"/> 2—7 дни <input type="text"/> 8—30 дни <input type="text"/> над 30 дни <input type="text"/>	
	е) доходност	
(A.4.8)	Кумулативна доходност	%
Диапазон	от началото на годината <input type="text"/> 1 месец <input type="text"/> 3 месеца <input type="text"/> 1 година <input type="text"/> 3 години <input type="text"/> 5 години <input type="text"/>	
(A.4.9)	Резултати за календарната година (нетна доходност) на най-представителния клас акции	%
Период	година N-1 <input type="text"/> година N-2 <input type="text"/> година N-3 <input type="text"/>	
(A.4.10)	Месечна променливост на стойността на портфейла и месечна променливост на пазарната НСА (когато е приложимо)	%
Период	1 година <input type="text"/> 2 години <input type="text"/> 3 години <input type="text"/>	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(5) Стрес тестове на ФПП		
а) <i>Резултати от стрес тестовете на ФПП</i>		
(A.5.1)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на ликвидността, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.2)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на кредитите, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.3)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на обменния курс на валутата, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.4)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на лихвения процент, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.5)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на равнището на откупуване, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.6)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на спреда между индексите, с които е обвързан лихвеният процент на ценните книжа в портфейла, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.7)	Резултати от стрес тестовете на ФПП по отношение на макроикономическата устойчивост, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.5.8)	Резултати от многомерните стрес тестове на ФПП, които се провеждат в рамките на отчетния период съгласно посоченото в член 28, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131 и съответните насоки на ЕОЦКП относно сценариите за стрес тестове	
(A.5.9)	При ФПП с постоянна НСА и ФПП със слабо променлива НСА посочете резултатите от стрес тестовете, определени в полета А.5.1 — А.5.8, под формата на разлика между постоянната НСА на дял или акция и НСА на дял или акция	
б) Предложение за план за действие (когато е приложено)		
(A.5.10)	Посочете предложението за план за действие, както е определено в член 28, параграф 4 от Регламент (ЕС) 2017/1131	Свободен текст
(6) Информация за активите в портфейла на ФПП		
а) Инструменти на паричния пазар, допустими секюритизации и обезпечени с активи търговски ценни книжа		
При попълването на полетата А.6 по-долу се използва образецът за докладване по редове		
(A.6.1)	Вид на инструмента на паричния пазар, допустимите секюритизации и обезпечените с активи търговски ценни книжа [изберете един или повече варианти]	
	Посочете вида на инструментите на паричния пазар, допустимите секюритизации и обезпечените с активи търговски ценни книжа	Инструменти на паричния пазар по член 10 от Регламент (ЕС) 2017/1131 Секюритизации, посочени в член 13 от Делегиран регламент (ЕС) 2015/61 на Комисията ⁽²⁾ Обезпечени с активи търговски ценни книжа по член 11, параграф 1, буква б) от Регламент (ЕС) 2017/1131 Опростена, прозрачна и стандартизирана секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга по член 11, параграф 1, буква в) от Регламент (ЕС) 2017/1131
	Ако видът на актива е инструмент на паричния пазар, попълнете полетата А.6.2 — А.6.20	
(A.6.2)	Описание на инструмента на паричния пазар	
(A.6.3)	ISIN код на инструмента на паричния пазар	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака

⁽²⁾ Делегиран регламент (ЕС) 2015/61 на Комисията от 10 октомври 2014 г. за допълнение на Регламент (ЕС) № 575/2013 на Европейския парламент и на Съвета по отношение на изискването за ликвидно покритие за кредитните институции (ОВ L 11, 17.1.2015 г., стр. 1).

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.6.4)	CFI код (ако има такъв и ако ISIN кодът не е наличен) на инструмента на паричния пазар	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(A.6.5)	ИКПС на емитента	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.6.6)	Наименование на емитента	
(A.6.7)	Категория на емитента Избира се категорията на емитента измежду съответните категории [изберете една]	Държава (от ЕС) Държава (извън ЕС) Централна банка (от държава от ЕС) Централна банка (от държава извън ЕС) Регионален орган на управление Местен орган на управление Национален публичен орган Публичен орган от ЕС (но не национален публичен орган) Публичен орган (от държави извън ЕС) Наднационален публичен орган (от ЕС) Наднационален публичен орган (извън ЕС) Кредитна институция Други финансови предприятия Нефинансови предприятия
(A.6.8)	Държавата на емитента на инструмента на паричния пазар	Код на държавата по ISO 3166
(A.6.9)	Падеж на инструмента на паричния пазар	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(A.6.10)	Валута на инструмента на паричния пазар	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
(A.6.11)	Количество на инструмента на паричния пазар	
(A.6.12)	Чиста цена на инструмента на паричния пазар	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.13)	Чиста цена на инструмента на паричния пазар	(в основната валута)
(A.6.14)	Нагрупани лихви	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.6.15)	Натрупани лихви	(в основната валута, ако A.6.14 е в EUR)
(A.6.16)	Обща пазарна стойност на инструмента на паричния пазар	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.17)	Обща пазарна стойност на инструмента на паричния пазар	(в основната валута)
(A.6.18)	Метод, използван за определяне на цената на инструмента на паричния пазар	оценка по пазарни цени оценка по модел амортизирана стойност
(A.6.19)	Посочва се дали оценката по вътрешната процедура за кредитна оценка е положителна или отрицателна	(положителна/отрицателна)
(A.6.20)	Въвежда се следващата дата на актуализация на лихвения процент (както е посочено в член 10, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2017/1131)	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
	Ако видът на актива е допустима секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга, попълнете полетата A.6.21 — A.6.37	
(A.6.21)	Описание на допустимата секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга	
(A.6.22)	ISIN код на допустимата секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(A.6.23)	Държава на спонсора на допустимата секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга	Код на държавата по ISO 3166
(A.6.24)	ИКПС на спонсора	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.6.25)	Наименование на спонсора	
(A.6.26)	Вид на базовите активи	Търговски вземания Потребителски кредити Лизинг Вземания по кредитни карти Кредити, отпуснати на големи предприятия или МСП Ипотеки върху жилищни имоти Ипотеки върху търговски недвижими имоти Други активи

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.6.27)	Падeж	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(A.6.28)	Валута	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
(A.6.29)	Количество	
(A.6.30)	Чиста цена	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.31)	Чиста цена	(в основната валута)
(A.6.32)	Натрупани лихви	
(A.6.33)	Натрупани лихви	(в основната валута, ако A.6.30 е в EUR)
(A.6.34)	Обща пазарна стойност	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.35)	Обща пазарна стойност	(в основната валута)
(A.6.36)	Метод, използван за определяне на цената на допустимата секюритизация или обезпечена с активи търговска ценна книга	оценка по пазарни цени оценка по модел амортизирана стойност
(A.6.37)	Посочва се дали оценката по вътрешната процедура за кредитна оценка е положителна или отрицателна	(положителна/отрицателна)
б) Други активи		
(A.6.38)	Вид на другите активи [изберете един] Видът на другите активи се избира измежду активите, изброени в член 9 от Регламент (ЕС) 2017/1131	Депозити в кредитни институции, посочени в член 12 от Регламент (ЕС) 2017/1131 Обратни репо споразумения, посочени в член 15 от Регламент (ЕС) 2017/1131 Репо споразумения, посочени в член 14 от Регламент (ЕС) 2017/1131 Дялове или акции от други ФПП, посочени в член 16 от Регламент (ЕС) 2017/1131

Статия	Вид данни	Докладвани данни
		Финансови деривативни инструменти, посочени в член 13 от Регламент (ЕС) 2017/1131, включващи: — финансови деривативни инструменти, търгувани на регулирания пазар (като се посочва дали влизат в обхвата на член 50, параграф 1, буква а), б) или в) от Директива 2009/65/ЕО) — финансови деривативни инструменти, търгувани на нерегулирания пазар Допълнителни ликвидни активи (в съответствие с член 50, параграф 2 от Директива 2009/65/ЕО)
	Ако видът на другия актив е финансов деривативен инструмент, се попълват полета А.6.39 — А.6.60	
(А.6.39)	Вид на деривативния договор	
(А.6.40)	ISIN код на финансовия деривативен инструмент	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(А.6.41)	UPI на финансовия деривативен инструмент (ако не е наличен ISIN код)	
(А.6.42)	Код FISN (съкратено наименование на финансовия инструмент) на финансовия деривативен инструмент	ISO 18774
(А.6.43)	CFI код (ако има такъв и ако ISIN кодът не е наличен) на финансовия деривативен инструмент	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(А.6.44)	Вид деривативен инструмент, посочен в член 13, буква а) от Регламент (ЕС) 2017/1131 [изберете един]	лихвен процент валути индекси на лихвени проценти индекси на валути
(А.6.45)	Наименование на базовия актив	
(А.6.46)	Вид идентификация на базовия актив ⁽³⁾	I = ISIN код X = индекс

⁽³⁾ Идентификация на финансовите деривативни инструменти по Регламента за европейската пазарна инфраструктура

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.6.47)	Идентификация на базовия актив	За идентификация на базовия актив от вида I: ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака За идентификация на базовия актив от вида X: ISIN код по ISO 6166 (12 буквено-цифрови знака), ако има такъв, в противен случай — пълно наименование на индекса, както е определено от доставчика на индекса
(A.6.48)	Условна валута 1 ⁽⁴⁾	Код на валутата по ISO 4217
(A.6.49)	Условна валута 2V ⁽⁵⁾	Код на валутата по ISO 4217
(A.6.50)	Държава на финансовия деривативен инструмент	Код на държавата по ISO 3166
(A.6.51)	Падеж на финансовия деривативен инструмент	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(A.6.52)	Експозиция на финансовия деривативен инструмент	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.53)	Експозиция на финансовия деривативен инструмент	(в основната валута)
(A.6.54)	Пазарна стойност на финансовия деривативен инструмент	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.55)	Пазарна стойност на финансовия деривативен инструмент	(в основната валута)
(A.6.56)	Пазарна стойност на полученото обезпечение (по отношение на финансовия деривативен инструмент)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.57)	Пазарна стойност на полученото обезпечение (по отношение на финансовия деривативен инструмент)	(в основната валута)
(A.6.58)	Въвежда се следващата дата на актуализация на лихвения процент (както е посочено в член 10, параграф 2 от Регламент (ЕС) 2017/1131)	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(A.6.59)	Наименование на контрагента	
(A.6.60)	ИКПС на контрагента	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака

⁽⁴⁾ Валута на условната сума. В случай на деривативен договор върху лихвен процент това е условната валута на компонент 1.

⁽⁵⁾ Валута на условната сума. В случай на деривативен договор върху лихвен процент това е условната валута на компонент 2.

Статия	Вид данни	Докладвани данни
	Ако видът на другия актив е дял или акция на друг ФПП, се попълват полета А.6.61 — А.6.71	
(А.6.61)	Описание на дела или акцията на друг ФПП	
(А.6.62)	ISIN код на дела или акцията на друг ФПП	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(А.6.63)	ИКПС (ако не е наличен ISIN) на дела или акцията на друг ФПП	
(А.6.64)	CFI код (ако не е наличен ISIN) на дела или акцията на друг ФПП	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(А.6.65)	Валута	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
(А.6.66)	Държава на дела или акцията на друг ФПП	Код на държавата по ISO 3166
(А.6.67)	Пазарна стойност на дела или акцията на друг ФПП	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(А.6.68)	Пазарна стойност на дела или акцията на друг ФПП	(в основната валута)
(А.6.69)	Количество	
(А.6.70)	Цена на дела или акцията на друг ФПП (НСА на дял или акция на друг ФПП)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(А.6.71)	Цена на дела или акцията на друг ФПП (НСА на дял или акция на друг ФПП)	(в основната валута)
	Ако видът на другия актив е депозит или допълнителни ликвидни активи, се попълват полета А.6.72 — А.6.81	
(А.6.72)	Описание на депозита или допълнителните ликвидни активи	
(А.6.73)	ISIN код на депозита или допълнителните ликвидни активи	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(А.6.74)	CFI код (ако има такъв и ако ISIN кодът не е наличен) на депозита или на допълнителните ликвидни активи	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(А.6.75)	Държава на депозита или допълнителните ликвидни активи	Код на държавата по ISO 3166

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.6.76)	Наименование на контрагента	
(A.6.77)	ИКПС на контрагента	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.6.78)	Падеж на депозита или допълнителните ликвидни активи	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГ-ММ-ДД)
(A.6.79)	Валута	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
(A.6.80)	Експозиция на депозита или допълнителните ликвидни активи	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.81)	Експозиция на депозита или допълнителните ликвидни активи	(в основната валута)
	Ако видът на другия актив е репо споразумение или обратно репо споразумение, се попълват полета A.6.82 — A.6.99	
(A.6.82)	Описание на репо споразумението или обратното репо споразумение	
(A.6.83)	ISIN код на репо споразумението или обратното репо споразумение	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(A.6.84)	CFI код (ако има такъв и ако ISIN кодът не е наличен) на репо споразумението или обратното репо споразумение	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(A.6.85)	Държава на репо споразумението или обратното репо споразумение	Код на държавата по ISO 3166
(A.6.86)	Категория на контрагента Категорията на контрагента се избира измежду следните категории (моля, вижте член 20, параграф 2, буква д) от Регламент (ЕС) 2017/1131) [изберете една]	Държава (от ЕС) Държава (извън ЕС) Централна банка (от държава от ЕС) Централна банка (от държава извън ЕС) Регионален орган на управление Местен орган на управление Национален публичен орган Публичен орган от ЕС (но не национален публичен орган) Публичен орган (от държави извън ЕС) Наднационален публичен орган (от ЕС) Наднационален публичен орган (извън ЕС)

Статия	Вид данни	Докладвани данни
		Кредитна институция Други финансови предприятия Нефинансови предприятия
(A.6.87)	ИКПС на контрагента	ИКПС по ISO 17442, 20 буквено-цифрови знака
(A.6.88)	Наименование на контрагента	
(A.6.89)	Падеж на репо споразумението или обратното репо споразумение	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГ-ММ-ДД)
(A.6.90)	Валута	Код на валутата по ISO 4217, 3 буквени знака
(A.6.91)	Експозиция на репо споразумението или обратното репо споразумение (в случай на обратно репо споразумение това е сумата на паричните средства, предоставени на контрагента)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.92)	Експозиция на репо споразумението или обратното репо споразумение (в случай на обратно репо споразумение това е сумата на паричните средства, предоставени на контрагента)	(в основната валута)
(A.6.93)	Пазарна стойност на полученото обезпечение (по отношение на репо споразумението или обратното репо споразумение) (размерът на получените от ФПП парични средства като част от репо споразумения, както е посочено в член 14, буква г) от Регламент (ЕС) 2017/1131)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.94)	Пазарна стойност на полученото обезпечение (по отношение на репо споразумението или обратното репо споразумение) (размерът на получените от ФПП парични средства като част от репо споразумения (както е посочено в член 14, буква г) от Регламент (ЕС) 2017/1131)	(в основната валута)
(A.6.95)	Посочва се дали оценката по вътрешната процедура за кредитна оценка е положителна или отрицателна (за различните ликвидни прехвърлими ценни книжа или (други) инструменти на паричния пазар, получени като част от обратно репо споразумение, както е посочено в член 15, параграф 6 от Регламент (ЕС) 2017/1131) ⁽⁶⁾	(положителна/отрицателна)

⁽⁶⁾ Ако ФПП получи като обезпечение различни активи по смисъла на член 15, параграф 6 на Регламент (ЕС) 2017/1131, оценката се докладва за всеки актив.

Статия	Вид данни	Докладвани данни
В контекста на обратните репо споразумения и активите, посочени в член 15 от Регламент (ЕС) 2017/1131, които са били получени от ФПП, моля, посочете:		
(A.6.96)	ISIN кода на тези различни активи	ISIN кода по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(A.6.97)	Пазарната стойност на тези различни активи	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(A.6.98)	Пазарната стойност на тези различни активи	(в основната валута)
(A.6.99)	В контекста на обратните репо споразумения, има ли активи, посочени в член 15, параграф 6 от Регламент (ЕС) 2017/1131, които са били получени от ФПП?	(да/не)
(7) Информация за пасивите на ФПП		
а) <i>Информация за инвеститорите — концентрация на инвеститорите</i>		
(A.7.1)	Посочете приблизителния процент от капитала на ФПП, който петте действителни собственика с най-голямо дялово участие в ФПП действително притежават, като процентен дял от НСА на ФПП. Подробен преглед на действителните крайни собственици, ако тази информация е налична или може да се представи	% (от НСА)
б) <i>Информация за инвеститорите — разпределение на концентрацията на инвеститорите</i>		
(A.7.2)	Представете разпределението на концентрацията на инвеститорите по статус на инвеститорите (представете оценки, ако няма точна налична информация): 1) Професионални клиенти, както са определени в член 4, параграф 1, точка 10 от Директива № 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета (*) (ДПФИ 2), и 2) непрофесионални клиенти, както са определени в член 4, параграф 1, точка 11 от Директива 2014/65/ЕС (ДПФИ 2)	
— професионални клиенти, както са определени в член 4, параграф 1, точка 10 от Директива № 2014/65/ЕС (ДПФИ 2)		% (от НСА)
— непрофесионални клиенти, както са определени в член 4, параграф 1, точка 11 от Директива № 2014/65/ЕС (ДПФИ 2)		% (от НСА)

(*) Директива 2014/65/ЕС на Европейския парламент и на Съвета от 15 май 2014 г. относно пазарите на финансови инструменти и за изменение на Директива 2002/92/ЕО и на Директива 2011/61/ЕС

Статия	Вид данни	Докладвани данни
в) Информация за инвеститорите — географско разпределение		
(A.7.3)	Представете разпределение на собствеността на дяловете/акциите във ФПП по групи инвеститори. Подробен преглед на действителните крайни собственици, ако тази информация е налична или може да се представи.	(% от НСА) Нефинансови предприятия Банки Застрахователни (осигурителни) предприятия Други финансови институции Пенсионни схеми/фондове Държавно управление Други предприятия за колективно инвестиране Домакинства Неизвестни
(A.7.4)	Представете географското разпределение на инвеститорите по държави (представете оценки, ако няма точна налична информация):	
	Държава	(% от НСА, държава — ISO 3166 — 2 знака)
г) Информация за инвеститорите — дейности по записване и откупуване		
Откупуване на дяловете/акциите на инвеститорите		
(A.7.5)	Посочете честотата на откупуване от инвеститорите. При множество класове дялове или акции се докладва за най-големия клас дялове или акции по НСА. [изберете един]	Дневно Седмично Месечно Двумесечно Друго Не са предоставени права за откупуване
(A.7.6)	Колко дни предварително инвеститорите трябва да уведомят за намерението си да поискат откупуване на дяловете/акциите си?	Дни
(A.7.7)	Към отчетната дата за какъв процент от нетната стойност на активите на ФПП се прилагат следните механизми:	
	Ограничения за откупуване	% от НСА

Статия	Вид данни	Докладвани данни
	Спиране на търгуването	% от НСА
	Такси за ликвидност	% от НСА
	Други механизми за управление на неликвидните активи	Вид механизъм % от НСА
(A.7.8)	Нетната стойност на активите на ФПП за отчетния период	(в евро, включително въздействието от записванията и откупванията) (в последния ден на месеца)
	януари	
	февруари	
	март	
	април	
	май	
	юни	
	юли	
	август	
	септември	
	октомври	
	ноември	
	декември	
(A.7.9)	Записвания през отчетния период	(в EUR)
	януари	
	февруари	
	март	
	април	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
	май	
	юни	
	юли	
	август	
	септември	
	октомври	
	ноември	
	декември	
(A.7.10)	Откупвания през отчетния период	(в EUR)
	януари	
	февруари	
	март	
	април	
	май	
	юни	
	юли	
	август	
	септември	
	октомври	
	ноември	
	декември	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(A.7.11)	Плащания към инвеститорите	(в EUR)
	януари	
	февруари	
	март	
	април	
	май	
	юни	
	юли	
	август	
	септември	
	октомври	
	ноември	
	декември	
	(A.7.12)	
	Обменен курс	
	януари	
	февруари	
	март	
	април	
	май	
	юни	
	юли	
	август	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
	септември	
	октомври	
	ноември	
	декември	

ФПП със слабо променлива НСА

Статия	Вид данни	Докладвани данни
--------	-----------	------------------

(В) Приложимо за ФПП със слабо променлива НСА

	а) Посочете всички случаи, в които цената на даден актив, оценена чрез използване на метода на амортизираната стойност в съответствие с член 29, параграф 7, първа алинея от Регламент (ЕС) 2017/1131, се отклонява от цената на актива, изчислена в съответствие с параграфи 2, 3 и 4 от член 29 от Регламент (ЕС) 2017/1131, с повече от 10 базисни пункта. Тези полета се попълват за всички активи, чиято цена, получена по метода на амортизираната стойност, би се отклонила по този начин.	
(В.1.1)	Дата на оценяването (първият ден на възникване на събитието)	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(В.1.2)	ISIN код на актива	ISIN код по ISO 6166, 12 буквено-цифрови знака
(В.1.3)	CFI код (ако има такъв и ако ISIN кодът не е наличен) на актива	CFI код по ISO 10692, 6 буквени знака
(В.1.4)	Цена (член 29, параграфи 2, 3 и 4 от Регламент (ЕС) 2017/1131) (към датата на оценяването, посочено в поле В.1.1, когато събитието настъпи)	
(В.1.5)	Цена (по метода на амортизираната стойност) (към датата на оценяването, посочена в поле В.1.1, когато събитието настъпи)	
(В.1.6)	Считано от датата на оценяването, посочена в поле В.1.1, посочете за какъв период цената на даден актив, оценен по метода на амортизираната стойност, се е различавала с повече от 10 базисни пункта от цената на този актив	(дни)
(В.1.7)	За периода, посочен в поле В.1.6, посочете средната разлика между двете стойности, споменати в поле В.1.6	

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(B.1.8)	За периода, посочен в поле B.1.6, посочете минималната разлика в цената между двете стойности	
(B.1.9)	За периода, посочен в поле B.1.6, посочете максималната разлика в цената между двете стойности	
	б) Посочете всички случаи, в които постоянната НСА на дял или акция, изчислена в съответствие с член 32, параграфи 1 и 2 от Регламент (ЕС) 2017/1131, се отклонява от НСА на дял или акция, изчислена в съответствие с член 30 от Регламент (ЕС) 2017/1131, с повече от 20 базисни пункта.	
(B.1.10)	Дата на оценяването (първият ден на възникване на събитието)	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(B.1.11)	Постоянна НСА (член 31 от Регламент (ЕС) 2017/1131) (към датата на оценяването, посочена в поле B.1.10, когато събитието настъпи)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(B.1.12)	Постоянна НСА (член 31 от Регламент (ЕС) 2017/1131) (към датата на оценяването, посочена в поле B.1.10, когато събитието настъпи)	(в основната валута)
(B.1.13)	НСА (член 30 от Регламент (ЕС) 2017/1131) (към датата на оценяването, посочена в поле B.1.10, когато събитието настъпи)	(в EUR) (ако основната валута не е EUR, се използва най-актуалният обменен курс, определен от Европейската централна банка)
(B.1.14)	НСА (член 30 от Регламент (ЕС) 2017/1131) (към датата на оценяването, посочена в поле B.1.10, когато събитието настъпи)	(в основната валута)
(B.1.15)	Считано от датата на оценяването, посочена в поле B.1.10, посочете за какъв период изчислената постоянна НСА на дял или акция, се е отклонявала от изчислената НСА на дял или акция с повече от 20 базисни пункта	(дни)
(B.1.16)	За периода, посочен в поле B.1.15, посочете средната разлика между двете стойности, споменати в поле B.1.15	
(B.1.17)	За периода, посочен в поле B.1.15, посочете минималната разлика в цената между двете стойности	
(B.1.18)	За периода, посочен в поле B.1.15, посочете максималната разлика в цената между двете стойности	
	в) Посочете всички случаи, в които възниква ситуацията, посочена в член 34, параграф 3 от Регламент (ЕС) 2017/1131, и мерките, предприети от съвета на директорите в съответствие с букви а) и б) от член 34, параграф 1 от същия регламент.	
(B.1.19)	Дата на събитието	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)

Статия	Вид данни	Докладвани данни
(B.1.20)	Датата на вземане на мярката	Датата по ISO 8601 във формат (ГГГГ-ММ-ДД)
(B.1.21)	Вид на мярката (когато делът на активите със седмичен падеж спадне под 30 % от общите активи на ФПП и когато нетните дневни откупвания в един работен ден надхвърлят 10 % от общите активи)	<p>такси за ликвидност при откупуване</p> <p>ограничения за откупуване</p> <p>спиране на откупуването</p> <p>предприемане на непосредствени действия единствено за коригиране на ситуацията, при която са надхвърлени границите, посочени в член 24, параграф 1 от Регламент (ЕС) 2017/1131, в съответствие с член 24, параграф 2 от същия регламент</p>
(B.1.22)	Вид на мярката (когато делът на активите със седмичен падеж спадне под 10 % от общите активи на ФПП)	<p>такси за ликвидност при откупуване</p> <p>спиране на откупуването</p>