

REGLAMENTO DE EJECUCIÓN (UE) 2018/708 DE LA COMISIÓN**de 17 de abril de 2018****por el que se establecen normas técnicas de ejecución en relación con el modelo que deben utilizar los gestores de fondos del mercado monetario al informar a las autoridades competentes, tal como establece el artículo 37 del Reglamento (UE) 2017/1131 del Parlamento Europeo y del Consejo****(Texto pertinente a efectos del EEE)**

LA COMISIÓN EUROPEA,

Visto el Tratado de Funcionamiento de la Unión Europea,

Visto el Reglamento (UE) 2017/1131 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 14 de junio de 2017, sobre fondos del mercado monetario ⁽¹⁾, y en particular su artículo 37, apartado 4,

Considerando lo siguiente:

- (1) Además de los requisitos de presentación de información establecidos en las Directivas 2009/65/CE ⁽²⁾ y 2011/61/UE ⁽³⁾ del Parlamento Europeo y del Consejo, es necesario prever requisitos de información adicionales que permitan a las autoridades competentes detectar, controlar y atajar eficazmente los riesgos que puedan existir en el mercado de fondos del mercado monetario (FMM).
- (2) Según el artículo 37 del Reglamento (UE) 2017/1131, los FMM deben suministrar a las autoridades competentes respectivas una completa serie de datos. En aras de la coherencia de las modalidades de recopilación de tales datos por parte de esas autoridades en toda la Unión Europea, y para garantizar que estén informadas de los principales acontecimientos en el mercado de FMM y puedan facilitar un análisis colectivo de los posibles efectos de dicho mercado sobre la Unión, la información debe transmitirse a las autoridades competentes de forma uniforme en toda la UE. Por otra parte, la utilización de un modelo estándar a tal efecto puede simplificar los procedimientos y procesos relacionados con los requisitos de presentación de información de los FMM y minimizar los costes correspondientes.
- (3) A fin de garantizar una supervisión eficaz en la Unión, tales datos deben remitirse a la Autoridad Europea de Valores y Mercados (AEVM), de modo que pueda establecerse una base de datos central sobre los FMM.
- (4) El presente Reglamento se basa en los proyectos de normas técnicas de ejecución presentados por la AEVM a la Comisión.
- (5) La AEVM ha llevado a cabo una consulta pública abierta sobre los proyectos de normas técnicas de ejecución en que se basa el presente Reglamento, ha analizado los costes y beneficios potenciales correspondientes y ha recabado el dictamen del Grupo de partes interesadas del sector de los valores y mercados, establecido de conformidad con el artículo 37 del Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo ⁽⁴⁾.
- (6) La fecha de aplicación del presente Reglamento de ejecución debe coincidir con la fecha de aplicación del Reglamento (UE) 2017/1131, para que las autoridades nacionales puedan recabar la información que habrán de remitir a la base de datos de la AEVM mencionada en el artículo 37, apartado 5, del Reglamento (UE) 2017/1131.

HA ADOPTADO EL PRESENTE REGLAMENTO:

Artículo 1

Los gestores de fondos del mercado monetario (FMM) utilizarán el modelo que figura en el anexo del presente Reglamento para presentar la información sobre los distintos FMM a la autoridad competente, tal como se establece en el artículo 37 del Reglamento (UE) 2017/1131.

⁽¹⁾ DO L 169 de 30.6.2017, p. 8.

⁽²⁾ Directiva 2009/65/CE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 13 de julio de 2009, por la que se coordinan las disposiciones legales, reglamentarias y administrativas sobre determinados organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) (versión refundida) (DO L 302 de 17.11.2009, p. 32).

⁽³⁾ Directiva 2011/61/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 8 de junio de 2011, relativa a los gestores de fondos de inversión alternativos y por la que se modifican las Directivas 2003/41/CE y 2009/65/CE y los Reglamentos (CE) n.º 1060/2009 y (UE) n.º 1095/2010 (DO L 174 de 1.7.2011, p. 1).

⁽⁴⁾ Reglamento (UE) n.º 1095/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 24 de noviembre de 2010, por el que se crea una Autoridad Europea de Supervisión (Autoridad Europea de Valores y Mercados), se modifica la Decisión n.º 716/2009/CE y se deroga la Decisión 2009/77/CE de la Comisión (DO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

Artículo 2

El presente Reglamento entrará en vigor a los veinte días de su publicación en el *Diario Oficial de la Unión Europea*.

Será aplicable a partir del 21 de julio de 2018.

El presente Reglamento será obligatorio en todos sus elementos y directamente aplicable en cada Estado miembro.

Hecho en Bruselas, el 17 de abril de 2018.

Por la Comisión
El Presidente
Jean-Claude JUNCKER

Modelo de presentación de información para los gestores de fondos del mercado monetario (FMM)

Salvo que se indique lo contrario, todas las cifras se cumplimentarán a nivel de subfondo

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
A) APLICABLE A TODOS LOS FMM		
(1) Características generales e identificación del FMM y de su gestor		
(A.1.1)	Período de referencia	
(A.1.2)	Código nacional del FMM atribuido por la autoridad competente del FMM	
(A.1.3)	LEI del FMM	Identificador de entidad jurídica (LEI) según la norma ISO 17442, código de 20 caracteres alfanuméricos
(A.1.4)	Código del BCE (código de identificación de IFM) para el FMM	
(A.1.5)	Nombre del FMM	
(A.1.6)	Indíquese si el FMM es un OICVM o un FIA	OICVM FIA
(A.1.7)	Indíquese si el FMM se comercializa únicamente a través de un plan de ahorro de empresa regido por el Derecho nacional y cuyos inversores son personas físicas [de conformidad con el art. 16, apartado 5, del Reglamento (UE) 2017/1131 ⁽¹⁾]	(Sí/No)
(A.1.8)	Domicilio del FMM	Código de país ISO 3166
(A.1.9)	Estado miembro en el que el FMM está autorizado	Código de país ISO 3166
(A.1.10)	Estados miembros en los que se comercializa el FMM	Lista de países (código de país ISO 3166)
(A.1.11)	Fecha de inicio del FMM	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.1.12)	Moneda de base del FMM	Código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras

⁽¹⁾ Reglamento (UE) 2017/1131 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 14 de junio de 2017, sobre fondos del mercado monetario

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.1.13)	Código nacional del gestor del FMM atribuido por la autoridad competente del FMM	
(A.1.14)	Código nacional del gestor del FMM atribuido por la autoridad competente del gestor del FMM	
(A.1.15)	LEI del gestor del FMM	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.1.16)	Código del BCE (código de identificación de IFM) para el gestor del FMM	
(A.1.17)	Nombre del gestor del FMM	
(A.1.18)	País donde el gestor del FMM está autorizado	
(A.1.19)	LEI del depositario del FMM	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.1.20)	Código nacional del depositario del FMM	
(A.1.21)	Razón social del depositario del FMM	
(2) Tipo de FMM		
(A.2.1)	Tipo de FMM [selecciónese uno]	FMM a corto plazo de valor liquidativo variable FMM a corto plazo de valor liquidativo constante de deuda pública FMM a corto plazo de valor liquidativo de baja volatilidad FMM de valor liquidativo variable estándar
(3) Otras características del FMM		
a) <i>Información principal/subordinado</i> (FMM comercializado únicamente a través de un plan de ahorro de empresa regido por el Derecho nacional y cuyos inversores son personas físicas)		
(A.3.1)	Si el FMM cumple las condiciones del artículo 16, apartado 5, del Reglamento (UE) 2017/1131, indíquese si se trata de un fondo principal o subordinado [selecciónese una opción]	Principal Subordinado
Si el FMM es subordinado:		
(A.3.2)	LEI del principal del FMM	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.3.3)	Código nacional del principal del FMM	
(A.3.4)	Razón social del principal del FMM	
b) Información sobre las clases de acciones		
(A.3.5)	Indíquese si el FMM tiene clases de acciones	(Sí/No)
(A.3.6)	En caso afirmativo, indíquese el ISIN individual de las distintas clases de acciones	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166
(A.3.7)	En caso afirmativo, indíquese la moneda de las distintas clases de acciones	Código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras
c) Información sobre el fondo o liquidación precedente (presentación de información no recurrente)		
Si el FMM ha sido fusionado con otro fondo, indíquese:		
(A.3.8)	Fecha de la fusión	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
Si el FMM está siendo objeto de liquidación, indíquese:		
(A.3.9)	Fecha de liquidación	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(4) Indicadores de cartera del FMM		
a) Valor total de los activos (a efectos del modelo de presentación de información conforme al Reglamento sobre los FMM, se considera que el valor total de los activos es igual al valor liquidativo, cf. campo A.4.1 infra)		
b) Valor liquidativo (al nivel de los subfondos, no clases de acciones)		
(A.4.1)	Valor liquidativo del FMM (nivel subfondo)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.4.2)	Valor liquidativo del FMM	(en la moneda de base)
c) Vencimiento medio ponderado		
(A.4.3)	Vencimiento medio ponderado del FMM, calculado con arreglo a lo establecido en el artículo 2, apartado 19, del Reglamento (UE) 2017/1131.	(días)

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	d) <i>Vida media ponderada</i>	
(A.4.4)	Vida media ponderada del FMM, calculada con arreglo a lo establecido en el artículo 2, apartado 20, el artículo 24, apartado 1, letra b) y el artículo 25, apartado 1, letra b), del Reglamento (UE) 2017/1131.	(días)
	e) <i>Indicadores de liquidez</i>	
	Perfil de liquidez de la cartera	
(A.4.5)	% de activos admisibles para el colchón de liquidez diario [activos con vencimiento diario, tal como se definen en los artículos 24 y 25 del Reglamento (UE) 2017/1131]	%
(A.4.6)	% de activos admisibles para el colchón de liquidez semanal [activos con vencimiento semanal, tal como se definen en los artículos 24 y 25 del Reglamento (UE) 2017/1131]	%
(A.4.7)	Perfil de liquidez de la cartera	Porcentaje de la cartera liquidable comprendido en cada período
Período	1 día o menos <input type="checkbox"/> 2-7 días <input type="checkbox"/> 8-30 días <input type="checkbox"/> más de 30 días <input type="checkbox"/>	
	f) <i>Rendimiento</i>	
(A.4.8)	Rendimiento acumulado	%
Intervalo	Desde el comienzo del ejercicio <input type="checkbox"/> 1 mes <input type="checkbox"/> 3 meses <input type="checkbox"/> 1 año <input type="checkbox"/> 3 años <input type="checkbox"/> 5 años <input type="checkbox"/>	
(A.4.9)	Rendimiento durante el año natural (rentabilidad neta) de la clase de acciones más representativa	%
Intervalo	Año N-1 <input type="checkbox"/> Año N-2 <input type="checkbox"/> Año N-3 <input type="checkbox"/>	
(A.4.10)	Volatilidad mensual de la cartera y volatilidad mensual de la cartera del valor liquidativo paralelo (cuando proceda)	%
Intervalo	1 año <input type="checkbox"/> 2 años <input type="checkbox"/> 3 años <input type="checkbox"/>	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(5) Pruebas de resistencia del FMM		
a) <i>Resultados de las pruebas de resistencia del FMM</i>		
(A.5.1)	Resultados de las pruebas de resistencia (liquidez) aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.2)	Resultados de las pruebas de resistencia (crédito) aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.3)	Resultados de las pruebas de resistencia (tipos de cambio) aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.4)	Resultados de las pruebas de resistencia (tipos de interés) aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.5)	Resultados de las pruebas de resistencia en cuanto a los niveles de reembolso aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.6)	Resultados de las pruebas de resistencia en cuanto a los diferenciales entre índices a los que están vinculados los tipos de interés de los valores de la cartera aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.7)	Resultados de las pruebas de resistencia (impactos macrosistémicos) aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.5.8)	Resultados de las pruebas de resistencia con múltiples variables aplicadas al FMM en el período de referencia, según lo establecido en el artículo 28, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131 y las correspondientes directrices de la AEVM sobre los escenarios de las pruebas de resistencia	
(A.5.9)	En el caso de los FMM de valor liquidativo constante y de valor liquidativo de baja volatilidad, indíquense los resultados de las pruebas de resistencia mencionadas en los campos A.5.1 a A.5.8 en términos de diferencia entre el valor liquidativo constante de cada acción o participación y el valor liquidativo de cada acción o participación	
b) <i>Plan de acción propuesto (en su caso)</i>		
(A.5.10)	Indíquese el plan de acción propuesto según lo establecido en el artículo 28, apartado 4, del Reglamento (UE) 2017/1131	Texto libre
(6) Información sobre los activos mantenidos en la cartera del FMM		
a) <i>Instrumentos del mercado monetario, titulaciones y pagarés de titulación aptos</i>		
Los campos A.6 siguientes se cumplimentarán utilizando un modelo de presentación de información línea por línea		
(A.6.1)	Tipo de instrumento del mercado monetario, titulación o pagaré de titulación apto [seleccione uno o varios]	
	Indíquese el tipo de instrumentos del mercado monetario, titulaciones o pagarés de titulación aptos	Instrumentos del mercado monetario con arreglo al artículo 10 del Reglamento (UE) 2017/1131 Titulaciones contempladas en el artículo 13 del Reglamento Delegado (UE) 2015/61 de la Comisión ⁽²⁾ Pagarés de titulación contemplados en el artículo 11, apartado 1, letra b), del Reglamento (UE) 2017/1131 Titulaciones o pagarés de titulación simples, transparentes y normalizados contemplados en el artículo 11, apartado 1, letra c), del Reglamento (UE) 2017/1131
	Si el tipo de activo es un instrumento del mercado monetario, rellénense los campos A.6.2 a A.6.20	
(A.6.2)	Descripción del instrumento del mercado monetario	
(A.6.3)	ISIN del instrumento del mercado monetario	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166

⁽²⁾ Reglamento Delegado (UE) 2015/61 de la Comisión, de 10 de octubre de 2014, por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que atañe al requisito de cobertura de liquidez aplicable a las entidades de crédito (DO L 11 de 17.1.2015, p. 1).

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.6.4)	CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) del instrumento del mercado monetario	Código CFI de 6 letras basado en la norma ISO 10692
(A.6.5)	Identificador de entidad jurídica (LEI) del emisor	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.6.6)	Nombre del emisor	
(A.6.7)	Categoría del emisor Se seleccionará la categoría pertinente [selecciónese una]	Soberano (UE) Soberano (no UE) Banco Central de la UE Banco Central no perteneciente a la UE Regional Local Organismo público nacional Organismo público de la UE (exceptuados organismos públicos nacionales) Organismo público no perteneciente a la UE Organismo público supranacional (UE) Organismo público supranacional (distintos de los de la UE) Entidad de crédito Otras sociedades financieras Sociedades no financieras
(A.6.8)	País del emisor del instrumento del mercado monetario	Código de país ISO 3166
(A.6.9)	Fecha de vencimiento del instrumento del mercado monetario	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.10)	Moneda del instrumento del mercado monetario	(código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras)
(A.6.11)	Cantidad del instrumento del mercado monetario	
(A.6.12)	Precio limpio del instrumento del mercado monetario	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.13)	Precio limpio del instrumento del mercado monetario	(en la moneda de base)
(A.6.14)	Intereses devengados	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.6.15)	Intereses devengados	(en la moneda de base, si A.6.14 se indica en EUR)
(A.6.16)	Valor total de mercado del instrumento del mercado monetario	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.17)	Valor total de mercado del instrumento del mercado monetario	(en la moneda de base)
(A.6.18)	Método utilizado para determinar el precio del instrumento del mercado monetario	valoración a precios de mercado valoración según modelo coste amortizado
(A.6.19)	Indíquese si el resultado del procedimiento de evaluación crediticia interna es favorable o desfavorable	(favorable/desfavorable)
(A.6.20)	Indíquese la próxima fecha de revisión del tipo de interés [según se menciona en el art. 10, apartado 2, del Reglamento (UE) 2017/1131]	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
	Si el tipo de activo es una titulización o un pagaré de titulización aptos, rellénense los campos A.6.21 a A.6.37	
(A.6.21)	Descripción de la titulización o el pagaré de titulización aptos	
(A.6.22)	ISIN de la titulización o el pagaré de titulización aptos	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166
(A.6.23)	País del promotor de la titulización o el pagaré de titulización aptos	Código de país ISO 3166
(A.6.24)	Identificador de entidad jurídica (LEI) del promotor	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.6.25)	Nombre del promotor	
(A.6.26)	Tipo de subyacente	Cartera comercial Créditos al consumo Arrendamientos financieros Derechos de cobro por tarjetas de crédito Préstamos a empresas o pymes Hipotecas residenciales Hipotecas comerciales Otros activos

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.6.27)	Fecha de vencimiento	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.28)	Moneda	(código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras)
(A.6.29)	Cantidad	
(A.6.30)	Precio limpio	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.31)	Precio limpio	(en la moneda de base)
(A.6.32)	Intereses devengados	
(A.6.33)	Intereses devengados	(en la moneda de base, si A.6.30 se indica en EUR)
(A.6.34)	Valor de mercado total	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.35)	Valor de mercado total	(en la moneda de base)
(A.6.36)	Método utilizado para determinar el precio de las titulaciones o pagarés de titulización aptos	valoración a precios de mercado valoración según modelo coste amortizado
(A.6.37)	Indíquese si el resultado del procedimiento de evaluación crediticia interna es favorable o desfavorable	(favorable/desfavorable)
b) Otros activos		
(A.6.38)	Tipo [selecciónese uno] Se seleccionará entre los tipos de activos mencionados en el artículo 9 del Reglamento (UE) 2017/1131	Depósitos en entidades de crédito contemplados en el artículo 12 del Reglamento (UE) 2017/1131 Pactos de recompra inversa contemplados en el artículo 15 del Reglamento (UE) 2017/1131 Pactos de recompra contemplados en el artículo 14 del Reglamento (UE) 2017/1131 Participaciones o acciones de otros FMM contemplados en el artículo 16 del Reglamento (UE) 2017/1131

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
		Instrumentos financieros derivados contemplados en el artículo 13 del Reglamento (UE) 2017/1131, en particular: — instrumentos financieros derivados negociados en un mercado regulado [especifíquese también si se ajusta al artículo 50, apartado 1, letras a), b) o c), de la Directiva 2009/65/CE] — instrumentos financieros derivados no negociados en un mercado organizado Activos líquidos accesorios (conforme al artículo 50, apartado 2, de la Directiva 2009/65/CE)
	Si el tipo pertinente es un instrumento financiero derivado, rellénense los campos A.6.39 a A.6.60	
(A.6.39)	Tipo de contrato del contrato de derivados	
(A.6.40)	ISIN del instrumento financiero derivado	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166
(A.6.41)	Identificador único de producto (UPI) del instrumento financiero derivado (si no se dispone del código ISIN)	
(A.6.42)	Nombre abreviado (FISN) del instrumento financiero derivado	ISO 18774
(A.6.43)	Código CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) del instrumento financiero derivado	Código CFI de 6 letras según la norma ISO 10692
(A.6.44)	Tipo de instrumento derivado según figura en el artículo 13, letra a), del Reglamento (UE) 2017/1131 [selecciónese uno]	tipo de interés divisas índices de tipos de interés índices de divisas
(A.6.45)	Nombre del subyacente	
(A.6.46)	Tipo de identificación del subyacente ⁽³⁾	I = ISIN X = Índice

⁽³⁾ Identificación del derivado financiero en el Reglamento EMIR

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.6.47)	Identificación del subyacente	En el caso de identificación del subyacente de tipo I: Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166 En el caso de identificación del subyacente de tipo X: Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166, si se conoce; en caso contrario, nombre completo del índice asignado por el proveedor del índice
(A.6.48)	Moneda nocional 1 ⁽⁴⁾	Código de país ISO 4217
(A.6.49)	Moneda nocional 2 ⁽⁵⁾	Código de país ISO 4217
(A.6.50)	País del instrumento financiero derivado	Código de país ISO 3166
(A.6.51)	Fecha de vencimiento del instrumento financiero derivado	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.52)	Exposición del instrumento financiero derivado	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.53)	Exposición del instrumento financiero derivado	(en la moneda de base)
(A.6.54)	Valor de mercado del instrumento financiero derivado	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.55)	Valor de mercado del instrumento financiero derivado	(en la moneda de base)
(A.6.56)	Valor de mercado de las garantías reales recibidas (en relación con el instrumento financiero derivado)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.57)	Valor de mercado de las garantías reales recibidas (en relación con el instrumento financiero derivado)	(en la moneda de base)
(A.6.58)	Indíquese la próxima fecha de revisión del tipo de interés [como se menciona en el art. 10, apartado 2, del Reglamento (UE) 2017/1131]	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.59)	Nombre de la contraparte	
(A.6.60)	Identificador de entidad jurídica (LEI) de la contraparte	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres basado en la norma ISO 17442

⁽⁴⁾ La moneda del importe nocional. En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés, se tratará de la moneda nocional del componente 1.

⁽⁵⁾ La moneda del importe nocional. En el caso de un contrato de derivados sobre tipos de interés, se tratará de la moneda nocional del componente 2.

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	Si el tipo pertinente es una participación o acción de otro FMM, rellénense los campos A.6.61 a A.6.71	
(A.6.61)	Descripción de la participación o acción de otro FMM	
(A.6.62)	ISIN de la participación o acción de otro FMM	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres basado en la norma ISO 6166
(A.6.63)	Identificador de entidad jurídica (LEI) (si no se dispone del código ISIN) de la acción o participación de otro FMM	
(A.6.64)	Código CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) de la acción o participación de otro FMM	Código CFI de 6 letras basado en la norma ISO 10692
(A.6.65)	Moneda	(código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras)
(A.6.66)	País de la participación o acción de otro FMM	Código de país ISO 3166
(A.6.67)	Valor de mercado de la participación o acción de otro FMM	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.68)	Valor de mercado de la participación o acción de otro FMM	(en la moneda de base)
(A.6.69)	Cantidad	
(A.6.70)	Precio de la participación o acción de otro FMM (valor liquidativo por participación o acción de otro FMM)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.71)	Precio de la participación o acción de otro FMM (valor liquidativo por participación o acción de otro FMM)	(en la moneda de base)
	Si el tipo pertinente es un depósito o activos líquidos accesorios, rellénense los campos A.6.72 a A.6.81	
(A.6.72)	Descripción de los activos del depósito o los activos líquidos accesorios	
(A.6.73)	ISIN del depósito o los activos líquidos accesorios	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166
(A.6.74)	CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) del depósito o los activos líquidos accesorios	Código CFI de 6 letras basado en la norma ISO 10692
(A.6.75)	País del depósito o los activos líquidos accesorios	Código de país ISO 3166

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.6.76)	Nombre de la contraparte	
(A.6.77)	Identificador de entidad jurídica (LEI) de la contraparte	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.6.78)	Fecha de vencimiento del depósito o los activos líquidos accesorios	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.79)	Moneda	(código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras)
(A.6.80)	Exposición del depósito o los activos líquidos accesorios	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.81)	Exposición del depósito o los activos líquidos accesorios	(en la moneda de base)
	Si el tipo pertinente es un pacto de recompra o un pacto de recompra inversa, rellénense los campos A.6.82 a A.6.99	
(A.6.82)	Descripción de los activos del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa	
(A.6.83)	ISIN del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres basado en la norma ISO 6166
(A.6.84)	CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa	Código CFI de 6 letras basado en la norma ISO 10692
(A.6.85)	País del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa	Código de país ISO 3166
(A.6.86)	Categoría de la contraparte La categoría pertinente se seleccionará entre las indicadas a continuación [véase el artículo 20, apartado 2, letra e), del Reglamento (UE) 2017/1131] [selecciónese una]	Soberano (UE) Soberano (no UE) Banco Central de la UE Banco Central no perteneciente a la UE Regional Local Organismo público nacional Organismo público de la UE (exceptuados organismos públicos nacionales) Organismo público no perteneciente a la UE Organismo público supranacional (UE) Organismo público supranacional (distintos de los de la UE)

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
		Entidad de crédito Otras sociedades financieras Sociedades no financieras
(A.6.87)	Identificador de entidad jurídica (LEI) de la contraparte	Código LEI alfanumérico de 20 caracteres según la norma ISO 17442
(A.6.88)	Nombre de la contraparte	
(A.6.89)	Fecha de vencimiento del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(A.6.90)	Moneda	(código de la moneda según la norma ISO 4217 de 3 letras)
(A.6.91)	Exposición del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa (en el caso del pacto de recompra inversa, es el importe de efectivo proporcionado a la contraparte)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.92)	Exposición del pacto de recompra o del pacto de recompra inversa (en el caso del pacto de recompra inversa, es el importe de efectivo proporcionado a la contraparte)	(en la moneda de base)
(A.6.93)	Valor de mercado de la garantía real recibida (en relación con el pacto de recompra o el pacto de recompra inversa) [el importe del efectivo recibido por el FMM como parte de los pactos de recompra, contemplado en el artículo 14, letra d), del Reglamento (UE) 2017/1131]	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.94)	Valor de mercado de la garantía real recibida (en relación con el pacto de recompra o el pacto de recompra inversa) [el importe del efectivo recibido por el FMM como parte de los pactos de recompra, contemplado en el artículo 14, letra d), del Reglamento (UE) 2017/1131]	(en la moneda de base)
(A.6.95)	Indíquese si el resultado del procedimiento de evaluación crediticia interna es favorable o desfavorable [para los distintos valores mobiliarios líquidos o (u otros) instrumentos del mercado monetario recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa según lo contemplado en el artículo 15, apartado 6, del Reglamento (UE) 2017/1131] (*)	(favorable/desfavorable)

(*) Si el FMM recibe como garantía real diferentes activos que se ajusten a lo dispuesto en el artículo 15, apartado 6, del Reglamento (UE) 2017/1131, debe comunicarse el resultado para cada activo.

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	En el marco de los pactos de recompra inversa y los activos a que se refiere el artículo 15 del Reglamento (UE) 2017/1131, que hayan sido recibidos por el FMM, indíquese:	
(A.6.96)	Código ISIN de estos distintos activos	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres basado en la norma ISO 6166
(A.6.97)	Valor de mercado de estos distintos activos	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(A.6.98)	Valor de mercado de estos distintos activos	(en la moneda de base)
(A.6.99)	En el marco de los pactos de recompra inversa, indíquese si el FMM ha recibido cualquiera de los activos a que se refiere el artículo 15, apartado 6, del Reglamento (UE) 2017/1131	(Sí/No)
(7) Información sobre los pasivos del FMM		
a) Información sobre los inversores: concentración de inversores		
(A.7.1)	Especifíquese el porcentaje aproximado del capital del FMM que pertenece de forma efectiva a los cinco propietarios efectivos que poseen la mayor participación en el capital del FMM, en porcentaje del valor liquidativo del FMM. Indíquense los propietarios efectivos, si se conocen o es factible	% (del valor liquidativo)
b) Información sobre los inversores: desglose de la concentración de inversores		
(A.7.2)	Especifíquese el desglose de la concentración de inversores por categoría de inversor (se hará una estimación si no se dispone de información exacta): 1) clientes profesionales (según se definen en el artículo 4, apartado 1, punto 10, de la Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo ⁽⁷⁾ [MiFID 2]); 2) clientes minoristas (según se definen en el artículo 4, apartado 1, punto 11, de la Directiva 2014/65/UE [MiFID 2])	
	— Clientes profesionales (según se definen en el artículo 4, apartado 1, punto 10, de la Directiva 2014/65/UE [MiFID 2])	% (del valor liquidativo)
	— Clientes minoristas (según se definen en el artículo 4, apartado 1, punto 11, de la Directiva 2014/65/UE [MiFID 2])	% (del valor liquidativo)

⁽⁷⁾ Directiva 2014/65/UE del Parlamento Europeo y del Consejo, de 15 de mayo de 2014, relativa a los mercados de instrumentos financieros y por la que se modifican la Directiva 2002/92/CE y la Directiva 2011/61/UE

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
<i>c) Información sobre los inversores: desglose geográfico</i>		
(A.7.3)	Facilítese un desglose de la titularidad de las participaciones/acciones del FMM por categoría de inversor. Indíquense los propietarios efectivos, si se conocen o es factible.	(% del valor liquidativo) Sociedades no financieras Bancos Compañías de seguros Otras entidades financieras Planes o fondos de pensiones Administraciones públicas Organismos de inversión colectiva Hogares Desconocido
(A.7.4)	Especifíquese el desglose geográfico de los inversores por país (se hará una estimación si no se dispone de información exacta):	
	País	(% del valor liquidativo, código de país de 2 caracteres basado en la norma ISO 3166)
<i>d) Información sobre los inversores: actividad de suscripción y de reembolso</i>		
Reembolsos al inversor		
(A.7.5)	Indíquese la frecuencia de los reembolsos al inversor. En caso de múltiples clases de acciones o participaciones, presente información en relación con la mayor clase de acciones o participaciones, por valor liquidativo. [Selecciónese una]	Diaria Semanal Mensual Bimestral Otra Sin derechos de reembolso
(A.7.6)	¿Qué plazo de preaviso, en número de días, exigen los inversores para el reembolso?	Días
(A.7.7)	En la fecha en que se informa, indíquese qué porcentaje del valor liquidativo del FMM está sujeto a los siguientes dispositivos:	
	Bloqueos de reembolso	% del valor liquidativo

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	Suspensión de negociación	% del valor liquidativo
	Comisiones de liquidez	% del valor liquidativo
	Otros dispositivos de gestión de activos ilíquidos	Tipo de dispositivo
		% del valor liquidativo
(A.7.8)	Valor liquidativo del FMM durante el período de referencia	(en EUR, teniendo en cuenta los efectos de las suscripciones y los reembolsos) (el último día del mes)
	Enero	
	Febrero	
	Marzo	
	Abril	
	Mayo	
	Junio	
	Julio	
	Agosto	
	Septiembre	
	Octubre	
	Noviembre	
	Diciembre	
(A.7.9)	Suscripciones durante el período de referencia	(en EUR)
	Enero	
	Febrero	
	Marzo	
	Abril	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	Mayo	
	Junio	
	Julio	
	Agosto	
	Septiembre	
	Octubre	
	Noviembre	
	Diciembre	
(A.7.10)	Reembolsos durante el período de referencia	(en EUR)
	Enero	
	Febrero	
	Marzo	
	Abril	
	Mayo	
	Junio	
	Julio	
	Agosto	
	Septiembre	
	Octubre	
	Noviembre	
	Diciembre	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(A.7.11)	Pagos a los inversores	(en EUR)
	Enero	
	Febrero	
	Marzo	
	Abril	
	Mayo	
	Junio	
	Julio	
	Agosto	
	Septiembre	
	Octubre	
	Noviembre	
	Diciembre	
(A.7.12)	Tipo de cambio	
	Enero	
	Febrero	
	Marzo	
	Abril	
	Mayo	
	Junio	
	Julio	
	Agosto	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
	Septiembre	
	Octubre	
	Noviembre	
	Diciembre	

FMM de valor liquidativo de baja volatilidad

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
---------	--------------	-----------------

B) APLICABLES A LOS FMM DE VALOR LIQUIDATIVO DE BAJA VOLATILIDAD

	a) Indíquese todo evento en que el precio de un activo valorado utilizando el método del coste amortizado conforme al artículo 29, apartado 7, párrafo primero, del Reglamento (UE) 2017/1131, se desvíe en más de 10 puntos básicos del precio de dicho activo calculado con arreglo al artículo 29, apartados 2, 3 y 4, del Reglamento (UE) 2017/1131. Estos campos deben consignarse para cada activo cuyo precio se desvíe de tal manera al utilizar el método del coste amortizado.	
(B.1.1)	Fecha de valoración (el primer día en que sucede el evento)	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(B.1.2)	Código ISIN del activo	Código ISIN alfanumérico de 12 caracteres según la norma ISO 6166
(B.1.3)	Código CFI (en caso de que no se disponga del código ISIN y esté disponible) del activo	Código CFI de 6 letras según la norma ISO 10692
(B.1.4)	Precio [artículo 29, apartados 2, 3 y 4, del Reglamento (UE) 2017/1131] (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.1 cuando sucede el evento)	
(B.1.5)	Precio (método del coste amortizado) (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.1 cuando sucede el evento)	
(B.1.6)	A partir de la fecha de valoración especificada en el campo B.1.1, consígnese la duración del período en que el precio de un activo valorado con arreglo al método del coste amortizado se desvíe en más de 10 puntos básicos del precio del activo	(días)
(B.1.7)	Para el período mencionado en el campo B.1.6, indíquese la diferencia media entre los dos valores consignados en el campo B.1.6	

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(B.1.8)	Para el período mencionado en el campo B.1.6, indíquese la desviación mínima del precio entre los dos valores	
(B.1.9)	Para el período mencionado en el campo B.1.6, indíquese la desviación máxima del precio entre los dos valores	
	b) Indíquese todo evento en que el valor liquidativo constante por acción o participación calculado con arreglo al artículo 32, apartados 1 y 2, del Reglamento (UE) 2017/1131 se desvíe en más de 20 puntos básicos del valor liquidativo por acción o participación calculado de conformidad con el artículo 30 del Reglamento (UE) 2017/1131.	
(B.1.10)	Fecha de valoración (el primer día en que sucede el evento)	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(B.1.11)	Valor liquidativo constante [artículo 31 del Reglamento (UE) 2017/1131] (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.10 cuando sucede el evento)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(B.1.12)	Valor liquidativo constante [artículo 31 del Reglamento (UE) 2017/1131] (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.10, cuando sucede el evento)	(en la moneda de base)
(B.1.13)	Valor liquidativo [artículo 30 del Reglamento (UE) 2017/1131] (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.10, cuando sucede el evento)	(en EUR) (si la moneda de base no es EUR se utilizará el último tipo de cambio establecido por el Banco Central Europeo)
(B.1.14)	Valor liquidativo [artículo 30 del Reglamento (UE) 2017/1131] (en la fecha de valoración mencionada en el campo B.1.10, cuando sucede el evento)	(en la moneda de base)
(B.1.15)	A partir de la fecha de valoración especificada en el campo B.1.10, consígnese la duración del período en que el valor liquidativo constante por acción o participación se desvíe en más de 20 puntos básicos del valor liquidativo por acción o participación	(días)
(B.1.16)	Para el período mencionado en el campo B.1.15, indíquese la diferencia media entre los dos valores consignados en el campo B.1.15	
(B.1.17)	Para el período mencionado en el campo B.1.15, indíquese la desviación mínima del precio entre los dos valores	
(B.1.18)	Para el período mencionado en el campo B.1.15, indíquese la desviación máxima del precio entre los dos valores	
	c) Indíquese todo evento en que se dé la situación mencionada en el artículo 34, apartado 3, del Reglamento (UE) 2017/1131, así como las medidas adoptadas por el consejo de administración de conformidad con el artículo 34, apartado 1, letras a) y b), de dicho Reglamento.	
(B.1.19)	Fecha del evento	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD

Rúbrica	Tipo de dato	Dato comunicado
(B.1.20)	Fecha de adopción de la medida	Fecha ISO 8601 en el formato AAAA-MM-DD
(B.1.21)	Tipo de medida (cuando la proporción de los activos con vencimiento semanal sea inferior al 30 % de los activos totales del FMM y las solicitudes de reembolso netas diarias en un día hábil superen el 10 % del total de los activos)	comisiones de liquidez sobre los reembolsos bloqueos de reembolso suspensión de reembolsos no adoptar ninguna medida inmediata distinta de la corrección de la situación cuando se rebasen los límites mencionados en el artículo 24, apartado 1, del Reglamento (UE) 2017/1131, de conformidad con el artículo 24, apartado 2, de dicho Reglamento
(B.1.22)	Tipo de medida (cuando la proporción de activos con vencimiento semanal sea inferior al 10 % de sus activos totales)	comisiones de liquidez sobre los reembolsos suspensión de reembolsos