

**ROZPORZĄDZENIE WYKONAWCZE KOMISJI (UE) 2018/708****z dnia 17 kwietnia 2018 r.****ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu stosowanego przez zarządzających funduszami rynku pieniężnego przy przekazywaniu właściwym organom informacji zgodnie z art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1131****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1131 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie funduszy rynku pieniężnego <sup>(1)</sup>, w szczególności jego art. 37 ust. 4,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) W uzupełnieniu wymogów sprawozdawczych określonych w dyrektywach Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE <sup>(2)</sup> i 2011/61/UE <sup>(3)</sup> niezbędne są dodatkowe wymogi sprawozdawcze w celu zapewnienia właściwym organom możliwości skutecznego wykrywania i monitorowania zagrożeń na rynku funduszy rynku pieniężnego (FRP) oraz reagowania na nie.
- (2) Zgodnie z art. 37 rozporządzenia (UE) 2017/1131 FRP są zobowiązane do dostarczania właściwym organom szczegółowego wykazu informacji. Aby zapewnić spójność w całej Unii Europejskiej w sposobie, w jaki organy te gromadzą takie dane, a także dopilnować, by organy te były informowane o najważniejszych wydarzeniach na rynku FRP i mogły przeprowadzić zbiorczą analizę potencjalnego wpływu rynku FRP w Unii, informacje te muszą być przekazywane właściwym organom w jednolity sposób w całej UE. Ponadto stosowanie standardowego formatu sprawozdania ułatwia przeprowadzanie procedur i procesów związanych z wymogami sprawozdawczymi dotyczącymi FRP i ogranicza do minimum związane z tym koszty.
- (3) W celu zapewnienia skutecznego nadzoru w całej Unii dane takie muszą być przekazywane Europejskiemu Urzędowi Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA), tak aby stworzyć centralną bazę danych dotyczących FRP.
- (4) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowią projekty wykonawczych standardów technicznych przedłożone Komisji przez ESMA.
- (5) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat projektów wykonawczych standardów technicznych, które stanowią podstawę niniejszego rozporządzenia, dokonał analizy możliwych powiązanych kosztów i korzyści oraz zasięgnął opinii Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 <sup>(4)</sup>.
- (6) Datę rozpoczęcia stosowania niniejszego rozporządzenia wykonawczego należy dostosować do daty rozpoczęcia stosowania rozporządzenia (UE) 2017/1131 w celu umożliwienia organom krajowym gromadzenia informacji, które mają być przekazywane do bazy danych ESMA, o której mowa w art. 37 ust. 5 rozporządzenia (UE) 2017/1131,

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

*Artykuł 1*

Zarządzający funduszami rynku pieniężnego (FRP) korzystają z formatu określonego w załączniku do niniejszego rozporządzenia przy przekazywaniu właściwemu dla danego FRP organowi informacji, zgodnie z przepisami art. 37 rozporządzenia (UE) 2017/1131.

<sup>(1)</sup> Dz.U. L 169 z 30.6.2017, s. 8.<sup>(2)</sup> Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2009/65/WE z dnia 13 lipca 2009 r. w sprawie koordynacji przepisów ustawowych, wykonawczych i administracyjnych odnoszących się do przedsiębiorstw zbiorowego inwestowania w zbywalne papiery wartościowe (UCITS) (wersja przekształcona) (Dz.U. L 302 z 17.11.2009, s. 32).<sup>(3)</sup> Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE z dnia 8 czerwca 2011 r. w sprawie zarządzających alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi i zmiany dyrektyw 2003/41/WE i 2009/65/WE oraz rozporządzeń (WE) nr 1060/2009 i (UE) nr 1095/2010 (Dz.U. L 174 z 1.7.2011, s. 1).<sup>(4)</sup> Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE oraz uchylecia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84).

*Artykuł 2*

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie stosuje się od dnia 21 lipca 2018 r.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 17 kwietnia 2018 r.

*W imieniu Komisji*  
Jean-Claude JUNCKER  
*Przewodniczący*

---

## ZAŁĄCZNIK

## Format sprawozdania przedkładanego przez zarządzających funduszami rynku pieniężnego (FRP)

O ile nie określono inaczej, wszystkie dane liczbowe należy podać na poziomie subfunduszy

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A) MAJĄCE ZASTOSOWANIE DO WSZYSTKICH FRP		
<b>1) Ogólna cechy, dane identyfikacje FRP i zarządzający tym FRP</b>		
(A.1.1)	Okres sprawozdawczy	
(A.1.2)	Kod krajowy FRP określony przez organ właściwy dla FRP	
(A.1.3)	LEI FRP	identyfikator podmiotu prawnego zgodnie z ISO 17442 – kod złożony z 20 znaków alfanumerycznych (LEI)
(A.1.4)	Kod EBC (identyfikator MIF) FRP	
(A.1.5)	Nazwa FRP	
(A.1.6)	Proszę wskazać, czy jest to UCITS lub AFI	UCITS AFI
(A.1.7)	Proszę wskazać, czy obrót FRP odbywa się wyłącznie poprzez pracownicze programy oszczędnościowe podlegające prawu krajowemu, których inwestorami są osoby fizyczne (zgodnie z art. 16 ust. 5 rozporządzenia (UE) 2017/1131 <sup>(1)</sup> )	(tak/nie)
(A.1.8)	Państwo, w którym znajduje się siedziba FRP	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.1.9)	Państwo członkowskie, w którym FRP uzyskał zezwolenie	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.1.10)	Państwa członkowskie, w których FRP jest wprowadzany do obrotu	wykaz państw (kody państw zgodnie z ISO 3166)
(A.1.11)	Data ustanowienia FRP	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.1.12)	Waluta bazowa FRP	trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217

<sup>(1)</sup> Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1131 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie funduszy rynku pieniężnego

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.1.13)	Kod krajowy zarządzającego FRP określony przez organ właściwy dla FRP	
(A.1.14)	Kod krajowy zarządzającego FRP określony przez organ właściwy dla zarządzającego FRP	
(A.1.15)	LEI zarządzającego FRP	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.1.16)	Kod EBC (identyfikator MIF) zarządzającego FRP	
(A.1.17)	Nazwa zarządzającego FRP	
(A.1.18)	Państwo, w którym zarządzający FRP otrzymał zezwolenie	
(A.1.19)	LEI depozytariusza FRP	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.1.20)	Krajowy kod depozytariusza FRP	
(A.1.21)	Zarejestrowana nazwa depozytariusza FRP	
<b>2) Rodzaj FRP</b>		
(A.2.1)	Rodzaj FRP [wybierz jeden]	krótkoterminowy FRP o zmiennej NAV krótkoterminowy FRP długu publicznego o stałej NAV krótkoterminowy FRP o niskiej zmienności NAV standardowy FRP o zmiennej NAV
<b>3) Inne cechy FRP</b>		
a) <i>Informacje na temat podstawowego/powiązanego FRP (FRP, którym obrót odbywa się wyłącznie poprzez pracownicze programy oszczędnościowe podlegające prawu krajowemu i których inwestorami są osoby fizyczne)</i>		
(A.3.1)	Jeżeli FRP spełnia warunki określone w art. 16 ust. 5 rozporządzenia (UE) 2017/1131, proszę wskazać, czy FRP jest funduszem podstawowym czy powiązany [wybierz jedną opcję]	podstawowy powiązany
Jeżeli FRP jest funduszem powiązany:		
(A.3.2)	LEI podstawowego FRP	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.3.3)	Krajowy kod podstawowego FRP	
(A.3.4)	Zarejestrowana nazwa podstawowego FRP	
b) <i>Informacje dotyczące kategorii udziałów</i>		
(A.3.5)	Proszę wskazać, czy FRP posiada kategorie udziałów	(tak/nie)
(A.3.6)	Jeżeli FRP posiada kategorie udziałów, proszę podać jeden kod ISIN dla różnych kategorii udziałów	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.3.7)	Jeżeli FRP posiada kategorie udziałów, proszę podać walutę poszczególnych kategorii udziałów	trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217
c) <i>Informacje dotyczące poprzedniego funduszu lub likwidacji (jednorazowe sprawozdanie)</i>		
Jeżeli FRP został połączony z innym funduszem, proszę wskazać:		
(A.3.8)	datę połączenia.	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
Jeżeli FRP podlega likwidacji, proszę wskazać:		
(A.3.9)	datę likwidacji.	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
<b>4) Wskaźniki portfela FRP</b>		
a) <i>Całkowita wartość aktywów (na potrzeby formatu sprawozdania na podstawie rozporządzenia w sprawie FRP uznaje się, że całkowita wartość aktywów jest równa NAV – zob. pole A.4.1 poniżej)</i>		
b) <i>NAV (poziom subfunduszu – nie kategorii udziałów)</i>		
(A.4.1)	Wartość aktywów netto FRP (poziom subfunduszu)	(EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.4.2)	Wartość aktywów netto FRP	(w walucie bazowej)
c) <i>WAM</i>		
(A.4.3)	Średni ważony termin zapadalności FRP obliczony w sposób określony w art. 2 ust. 19 rozporządzenia (UE) 2017/1131.	(dni)

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	d) WAL	
(A.4.4)	Średni ważony okres trwania FRP obliczony w sposób określony w art. 2 ust. 20, art. 24 ust. 1 lit. b) i art. 25 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/1131.	(dni)
	e) Wskaźniki dotyczące płynności	
	Profil płynności portfela	
(A.4.5)	% aktywów kwalifikujących się do dziennego zabezpieczenia przed utratą płynności (aktywa o jednodniowym terminie zapadalności zgodnie z definicją w art. 24 i 25 rozporządzenia (UE) 2017/1131)	%
(A.4.6)	% aktywów kwalifikujących się do tygodniowego zabezpieczenia przed utratą płynności (wartość aktywów o tygodniowym terminie zapadalności zgodnie z definicją w art. 24 i 25 rozporządzenia (UE) 2017/1131)	%
(A.4.7)	Profil płynności portfela	odsetek portfela, który można zlikwidować w poszczególnych okresach
Okres	1 dzień lub mniej <input type="checkbox"/> 2–7 dni <input type="checkbox"/> 8–30 dni <input type="checkbox"/> Powyżej 30 dni <input type="checkbox"/>	
	f) Zysk	
(A.4.8)	Zyski ogółem	%
Zakres	Wynik od początku roku do danego dnia <input type="checkbox"/> 1 miesiąc <input type="checkbox"/> 3 miesiące <input type="checkbox"/> 1 rok <input type="checkbox"/> 3 lata <input type="checkbox"/> 5 lat <input type="checkbox"/>	
(A.4.9)	Wynik za rok kalendarzowy (zysk netto) najbardziej reprezentatywnej klasy udziałów	%
Zakres	Rok N-1 <input type="checkbox"/> Rok N-2 <input type="checkbox"/> Rok N-3 <input type="checkbox"/>	
(A.4.10)	Miesięczna zmienność portfela i miesięczna zmienność portfela kalkulacyjnej NAV (o ile ma zastosowanie)	%
Zakres	1 rok <input type="checkbox"/> 2 lata <input type="checkbox"/> 3 lata <input type="checkbox"/>	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
<b>5) Testy warunków skrajnych FRP</b>		
a) Wyniki testów warunków skrajnych FRP		
(A.5.1)	Wyniki testów warunków skrajnych FRP dotyczących płynności przeprowadzonych w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.2)	Wyniki testów warunków skrajnych FRP dotyczących ryzyka kredytowego przeprowadzonych w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.3)	Wyniki testów warunków skrajnych FRP dotyczących kursu wymiany przeprowadzonych w okresie sprawozdawczym określonym w ust. 28(1) rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.4)	Wyniki testów warunków skrajnych FRP dotyczących stóp procentowych przeprowadzonych w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.5)	Wyniki testu warunków skrajnych FRP dotyczącego poziomu umarzania przeprowadzonego w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.6)	Wyniki testu warunków skrajnych FRP dotyczących spreadu w przypadku indeksów, z którymi powiązana jest stopa procentowa papierów wartościowych portfela przeprowadzonego w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.7)	Wyniki testu warunków skrajnych FRP w skali makro przeprowadzonego w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.5.8)	Wyniki wielowymiarowego testu warunków skrajnych FRP przeprowadzonego w okresie sprawozdawczym określonym w art. 28 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131 oraz odpowiednich wytycznych ESMA dotyczących scenariuszy testów warunków skrajnych	
(A.5.9)	W przypadku FRP o stałej NAV oraz FRP o niskiej zmienności NAV proszę podać wyniki testów warunków skrajnych, o których mowa w polach od A.5.1 do A.5.8, w zakresie różnicy między stałą NAV przypadającą na jednostkę uczestnictwa lub udział a NAV przypadającą na jednostkę uczestnictwa lub udział	
b) <i>Proponowany plan działania (w stosownych przypadkach)</i>		
(A.5.10)	Wskazać proponowany plan działania określony w art. 28 ust. 4 rozporządzenia (UE) 2017/1131	pole na tekst dowolny
<b>6) Informacje na temat aktywów utrzymywanych w portfelu FRP</b>		
a) <i>Instrumenty rynku pieniężnego, kwalifikowalne sekurytyzacje i papiery dłużne przedsiębiorstw zabezpieczone aktywami</i>		
<i>Pola sekcji A.6 poniżej należy wypełnić przy użyciu formatu sprawozdania „pozycja po pozycji”</i>		
(A.6.1)	Rodzaj instrumentu rynku pieniężnego, kwalifikowalne sekurytyzacje i papiery dłużne przedsiębiorstw zabezpieczone aktywami [wybierz jeden lub kilka]	
	Proszę wskazać instrumenty rynku pieniężnego, kwalifikowalne sekurytyzacje i papiery dłużne przedsiębiorstw zabezpieczone aktywami	instrumenty rynku pieniężnego na podstawie art. 10 rozporządzenia (UE) 2017/1131 sekurytyzacje, o których mowa w art. 13 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2015/61 <sup>(2)</sup> papiery dłużne przedsiębiorstw zabezpieczone aktywami, o których mowa w art. 11 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/1131 proste, przejrzyste i standardowe sekurytyzacje oraz papiery dłużne przedsiębiorstw zabezpieczone aktywami, o których mowa w art. 11 ust. 1 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/1131
	<b>Jeżeli składnikiem aktywów jest instrument rynku pieniężnego, proszę wypełnić pola od A.6.2 do A.6.20</b>	
(A.6.2)	Opis składnika aktywów będącego instrumentem rynku pieniężnego	
(A.6.3)	Kod ISIN instrumentu rynku pieniężnego	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych

<sup>(2)</sup> Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2015/61 z dnia 10 października 2014 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 w odniesieniu do wymogu pokrycia wpływów netto dla instytucji kredytowych (Dz.U. L 11 z 17.1.2015, s. 1).



Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.6.4)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) instrumentu rynku pieniężnego	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(A.6.5)	LEI emitenta	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.6.6)	Nazwa emitenta	
(A.6.7)	Kategoria emitenta Kategorię emitenta należy wybrać spośród następujących pozycji [wybierz jedną]	państwo (UE) państwo (spoza UE) bank centralny z UE bank centralny spoza UE regionalny lokalny krajowy organ publiczny organ publiczny UE (z wyjątkiem krajowych organów publicznych) organ publiczny spoza UE ponadnarodowy organ publiczny (UE) ponadnarodowy organ publiczny (inny niż UE) instytucja kredytowa inne instytucje finansowe przedsiębiorstwa niefinansowe
(A.6.8)	Państwo siedziby emitenta instrumentu rynku pieniężnego	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.6.9)	Termin zapadalności instrumentu rynku pieniężnego	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.10)	Waluta instrumentu rynku pieniężnego	(trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217)
(A.6.11)	Liczba instrumentów rynku pieniężnego	
(A.6.12)	Cena czysta instrumentu rynku pieniężnego	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.13)	Cena czysta instrumentu rynku pieniężnego	(w walucie bazowej)
(A.6.14)	Naliczone odsetki	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.6.15)	Naliczone odsetki	(w walucie bazowej, jeżeli A.6.14 w EUR)
(A.6.16)	Całkowita wartość rynkowa instrumentu rynku pieniężnego	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.17)	Całkowita wartość rynkowa instrumentu rynku pieniężnego	(w walucie bazowej)
(A.6.18)	Metoda stosowana do wyceny instrumentu rynku pieniężnego	wycena według wartości rynkowej wycena według modelu koszt zamortyzowany
(A.6.19)	Proszę wskazać, czy wynik procedury wewnętrznej oceny kredytowej jest pozytywny czy negatywny	(pozytywny/negatywny)
(A.6.20)	Proszę podać datę następnej aktualizacji stóp procentowych (jak określono w art. 10 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/1131)	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
	<b>Jeżeli składnikiem aktywów jest kwalifikowalna sekurytyzacja lub papier dłużny przedsiębiorstw zabezpieczony aktywami, proszę wypełnić pola od A.6.21 do A.6.37</b>	
(A.6.21)	Opis składnika aktywów będącego kwalifikowalną sekurytyzacją lub papierem dłużnym przedsiębiorstw zabezpieczonym aktywami	
(A.6.22)	Kod ISIN kwalifikowalnej sekurytyzacji lub papieru dłużnego przedsiębiorstw zabezpieczonego aktywami	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.23)	Państwo siedziby jednostki sponsorującej kwalifikowalnej sekurytyzacji lub papieru dłużnego przedsiębiorstw zabezpieczonego aktywami	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.6.24)	LEI jednostki sponsorującej	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.6.25)	Nazwa jednostki sponsorującej	
(A.6.26)	Rodzaj instrumentu bazowego	należności z tytułu dostaw i usług kredyty konsumenckie leasing wierzytelności z tytułu kart kredytowych kredyty dla przedsiębiorstw lub MŚP zabezpieczenie hipoteczne na nieruchomości mieszkalnej zabezpieczenie hipoteczne na nieruchomości komercyjnej inne aktywa

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.6.27)	Termin zapadalności	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.28)	Waluta	(trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217)
(A.6.29)	Ilość	
(A.6.30)	Cena czysta	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.31)	Cena czysta	(w walucie bazowej)
(A.6.32)	Naliczone odsetki	
(A.6.33)	Naliczone odsetki	(w walucie bazowej, jeżeli A.6.30 w EUR)
(A.6.34)	Całkowita wartość rynkowa	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.35)	Całkowita wartość rynkowa	(w walucie bazowej)
(A.6.36)	Metoda stosowana do wyceny kwalifikowalnych sekurytyzacji lub papieru dłużnego przedsiębiorstw zabezpieczonego aktywami	wycena według wartości rynkowej wycena według modelu koszt zamortyzowany
(A.6.37)	Proszę wskazać, czy wynik procedury wewnętrznej oceny kredytowej jest pozytywny czy negatywny	(pozytywny/negatywny)
b) <i>Inne aktywa</i>		
(A.6.38)	Rodzaj innych aktywów [wybierz jeden] Rodzaj innych aktywów należy wybrać spośród aktywów wymienionych w art. 9 rozporządzenia (UE) 2017/1131	depozyty w instytucjach kredytowych, o których mowa w art. 12 rozporządzenia (UE) 2017/1131 umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o których mowa w art. 15 rozporządzenia (UE) 2017/1131 umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu, o których mowa w art. 14 rozporządzenia (UE) 2017/1131 jednostki uczestnictwa lub udziały w innych FRP, jak określono w art. 16 rozporządzenia (UE) 2017/1131

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
		finansowe instrumenty pochodne, o których mowa w art. 13 rozporządzenia (UE) 2017/1131, w tym: <ul style="list-style-type: none"> <li>— finansowe instrumenty pochodne będące przedmiotem obrotu na rynku regulowanym (i określić czy są objęte art. 50 ust. 1 lit. a), b) lub c) dyrektywy 2009/65/WE)</li> <li>— finansowe instrumenty pochodne będące przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym</li> </ul> pomocnicze aktywa płynne (zgodnie z art. 50 ust. 2 dyrektywy 2009/65/WE)
	<b>Jeżeli innym składnikiem aktywów jest finansowy instrument pochodny, proszę wypełnić pola od A.6.39 do A.6.60</b>	
(A.6.39)	Rodzaj umowy na instrument pochodny	
(A.6.40)	Kod ISIN finansowego instrumentu pochodnego	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.41)	Kod UPI finansowego instrumentu pochodnego (jeżeli kod ISIN nie jest dostępny)	
(A.6.42)	FISN (skrótowa nazwa instrumentu finansowego) finansowego instrumentu pochodnego	ISO 18774
(A.6.43)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) finansowego instrumentu pochodnego	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(A.6.44)	Rodzaj instrumentu pochodnego określony w art. 13 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/1131 [wybierz jeden]	stopa procentowa waluty indeksy stóp procentowych indeksy walutowe
(A.6.45)	Nazwa instrumentu bazowego	
(A.6.46)	Rodzaj identyfikatora instrumentu bazowego <sup>(3)</sup>	I = ISIN X = indeks

<sup>(3)</sup> Identyfikator finansowego instrumentu pochodnego w EMIR

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.6.47)	Identyfikator instrumentu bazowego	w przypadku identyfikatora instrumentu bazowego „I”: kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych; w przypadku identyfikatora instrumentu bazowego „X”: jeżeli jest dostępny, kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych, w innych przypadkach – pełna nazwa indeksu nadana przez dostawcę indeksu
(A.6.48)	Waluta nominalna 1 <sup>(4)</sup>	kod waluty zgodnie z ISO 4217
(A.6.49)	Waluta nominalna 2 <sup>(5)</sup>	kod waluty zgodnie z ISO 4217
(A.6.50)	Państwo finansowego instrumentu pochodnego	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.6.51)	Termin zapadalności finansowego instrumentu pochodnego	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.52)	Ryzyko związane z finansowym instrumentem pochodnym	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.53)	Ryzyko związane z finansowym instrumentem pochodnym	(w walucie bazowej)
(A.6.54)	Wartość rynkowa finansowego instrumentu pochodnego	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.55)	Wartość rynkowa finansowego instrumentu pochodnego	(w walucie bazowej)
(A.6.56)	Wartość rynkowa otrzymanego zabezpieczenia (w odniesieniu do finansowego instrumentu pochodnego)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.57)	Wartość rynkowa otrzymanego zabezpieczenia (w odniesieniu do finansowego instrumentu pochodnego)	(w walucie bazowej)
(A.6.58)	Proszę podać datę następnej aktualizacji stóp procentowych (jak określono w art. 10 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/1131)	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.59)	Nazwa kontrahenta	
(A.6.60)	LEI kontrahenta	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych

<sup>(4)</sup> Waluta kwoty nominalnej. W przypadku kontraktu pochodnego na stopę procentową będzie to waluta nominalna części 1.

<sup>(5)</sup> Waluta kwoty nominalnej. W przypadku kontraktu pochodnego na stopę procentową będzie to waluta nominalna części 2.

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	<b>Jeżeli innym składnikiem aktywów jest jednostka uczestnictwa lub udział w innym FRP, proszę wypełnić pola od A.6.61 do A.6.71</b>	
(A.6.61)	Opis składnika aktywów będącego jednostką uczestnictwa lub udziałem w innym FRP	
(A.6.62)	Kod ISIN jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.63)	LEI (jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	
(A.6.64)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(A.6.65)	Waluta	(trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217)
(A.6.66)	Państwo jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.6.67)	Wartość rynkowa jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.68)	Wartość rynkowa jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP	(w walucie bazowej)
(A.6.69)	Ilość	
(A.6.70)	Cena jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP (NAV przypadająca na jednostkę uczestnictwa lub udział w innym FRP)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.71)	Cena jednostki uczestnictwa lub udziału w innym FRP (NAV przypadająca na jednostkę uczestnictwa lub udział w innym FRP)	(w walucie bazowej)
	<b>Jeżeli innym składnikiem aktywów jest depozyt lub pomocnicze aktywa płynne, proszę wypełnić pola od A.6.72 do A.6.81</b>	
(A.6.72)	Opis składnika aktywów będącego depozytem lub pomocniczymi aktywami płynnymi	
(A.6.73)	Kod ISIN depozytu lub pomocniczych aktywów płynnych	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.74)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) depozytu lub pomocniczych aktywów płynnych	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(A.6.75)	Państwo depozytu lub pomocniczych aktywów płynnych	kod państwa zgodnie z ISO 3166

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.6.76)	Nazwa kontrahenta	
(A.6.77)	LEI kontrahenta	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.6.78)	Termin zapadalności depozytu lub pomocniczych aktywów płynnych	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.79)	Waluta	(trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217)
(A.6.80)	Ryzyko związane z depozytem lub pomocniczymi aktywami płynnymi	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.81)	Ryzyko związane z depozytem lub pomocniczymi aktywami płynnymi	(w walucie bazowej)
	<b>Jeżeli innym składnikiem aktywów jest umowa z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowa z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, proszę wypełnić pola od A.6.82 do A.6.99</b>	
(A.6.82)	Opis składnika aktywów będącego umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	
(A.6.83)	Kod ISIN umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.84)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(A.6.85)	Państwo umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	kod państwa zgodnie z ISO 3166
(A.6.86)	Kategoria kontrahenta Kategorię kontrahenta należy wybrać spośród następujących kategorii (zob. art. 20 ust. 2 lit. e) rozporządzenia (UE) 2017/1131) [wybierz jedną]	państwo (UE) państwo (spoza UE) bank centralny z UE bank centralny spoza UE regionalny lokalny krajowy organ publiczny organ publiczny UE (z wyjątkiem krajowych organów publicznych) organ publiczny spoza UE ponadnarodowy organ publiczny (UE) ponadnarodowy organ publiczny (inny niż UE)

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
		instytucja kredytowa inne instytucje finansowe przedsiębiorstwa niefinansowe
(A.6.87)	LEI kontrahenta	kod LEI zgodnie z ISO 17442, złożony z 20 znaków alfanumerycznych
(A.6.88)	Nazwa kontrahenta	
(A.6.89)	Termin zapadalności umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(A.6.90)	Waluta	(trzyliterowy kod waluty zgodnie z ISO 4217)
(A.6.91)	Ryzyko związane z umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu (w przypadku umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, jest to kwota środków pieniężnych przekazanych kontrahentowi)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.92)	Ryzyko związane z umową z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umową z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu (w przypadku umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, jest to kwota środków pieniężnych przekazanych kontrahentowi)	(w walucie bazowej)
(A.6.93)	Wartość rynkowa otrzymanego zabezpieczenia (w odniesieniu do umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu) (kwota środków pieniężnych otrzymanych przez FRP w ramach umów z udzielonym przyrzeczeniem zakupu (o których mowa w art. 14 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/1131)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.94)	Wartość rynkowa otrzymanego zabezpieczenia (w odniesieniu do umowy z udzielonym przyrzeczeniem odkupu lub umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu) (kwota środków pieniężnych otrzymanych przez FRP w ramach umów z udzielonym przyrzeczeniem zakupu (o których mowa w art. 14 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/1131)	(w walucie bazowej)
(A.6.95)	Proszę wskazać, czy wynik procedury wewnętrznej oceny kredytowej jest pozytywny czy negatywny (w przypadku innych płynnych zbywalnych papierów wartościowych lub (innych) instrumentów rynku pieniężnego otrzymanych w ramach umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, o której mowa w art. 15 ust. 6 rozporządzenia (UE) 2017/1131) <sup>(6)</sup>	(pozytywny/negatywny)

<sup>(6)</sup> Jeżeli FRP otrzymuje jako zabezpieczenie inne aktywa w rozumieniu art. 15 ust. 6 rozporządzenia (UE) 2017/1131, należy wskazać wynik odrębnie dla każdego składnika aktywów.



Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	W kontekście umowy z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu i aktywów, o których mowa w art. 15 rozporządzenia (UE) 2017/1131, otrzymanych przez FRP, proszę wskazać:	
(A.6.96)	Kod ISIN tych innych aktywów	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(A.6.97)	Wartość rynkowa tych innych aktywów	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(A.6.98)	Wartość rynkowa tych innych aktywów	(w walucie bazowej)
(A.6.99)	W kontekście umów z otrzymanym przyrzeczeniem odkupu, wskazać czy FRP otrzymał aktywa, o których mowa w art. 15 ust. 6 rozporządzenia (UE) 2017/1131	(tak/nie)
<b>7) Informacje o zobowiązaniach FRP</b>		
a) <i>Informacje o inwestorach – koncentracja inwestorów</i>		
(A.7.1)	Proszę określić w przybliżeniu odsetek kapitału własnego FRP, który znajduje się w posiadaniu pięciu właścicieli rzeczywistych dysponujących największymi udziałami w kapitale własnym FRP (wyrażony jako % NAV FRP). Pełny przegląd do poziomu właścicieli rzeczywistych, jeżeli są oni znani lub jeżeli jest to możliwe	% (NAV)
b) <i>Informacje o inwestorach – podział według koncentracji inwestorów</i>		
(A.7.2)	Proszę przedstawić strukturę koncentracji inwestorów według ich statusu (podać dane szacunkowe w przypadku braku dostępu do dokładnych informacji): 1) klienci profesjonalni (zdefiniowani w art. 4 ust. 1 pkt 10) dyrektywy Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE <sup>(7)</sup> (MiFID 2)) 2) klienci detaliczni (zdefiniowani w art. 4 ust. 1 pkt 11) dyrektywy 2014/65/UE (MiFID 2))	
	— klienci profesjonalni (zdefiniowani w art. 4 ust. 1 pkt 10) dyrektywy 2014/65/UE (MiFID 2))	% (NAV)
	— klienci detaliczni (zdefiniowani w art. 4 ust. 1 pkt 11) dyrektywy 2014/65/UE (MiFID 2))	% (NAV)

(7) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniająca dyrektywę 2002/92/WE i dyrektywę 2011/61/UE.

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
c) <i>Informacje o inwestorach – podział geograficzny</i>		
(A.7.3)	Proszę przedstawić strukturę własności jednostek uczestnictwa lub udziałów w FRP według grup inwestorów. Pełny przegląd do poziomu właścicieli rzeczywistych, jeżeli są oni znani lub jeżeli jest to możliwe.	(% NAV) przedsiębiorstwa niefinansowe banki instytucje ubezpieczeniowe pozostałe instytucje finansowe programy/fundusze emerytalne sektor instytucji rządowych i samorządowych inne przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania gospodarstwa domowe nieznane
(A.7.4)	Proszę przedstawić podział geograficzny inwestorów w podziale na państwa (podać dane szacunkowe w przypadku braku dostępności dokładnych informacji)	
	Państwo	(% NAV, państwo – ISO 3166 – dwuliterowy kod)
d) <i>Informacje na temat inwestorów – działania związane z subskrypcją i umorzeniem</i>		
Prawo inwestorów do umorzenia		
(A.7.5)	Proszę wskazać częstotliwość korzystania z prawa do umorzenia przez inwestorów. W przypadku wielu klas udziałów lub jednostek uczestnictwa należy wskazać największą klasę – pod względem wartości aktywów netto – udziałów lub jednostek uczestnictwa.[wybierz jedną]	codziennie co tydzień co miesiąc dwa razy w miesiącu inne bez praw do umorzenia
(A.7.6)	Proszę wskazać jakiego wyprzedzenia (w dniach) wymagają inwestorzy na potrzeby umorzenia	Dni
(A.7.7)	Na dzień sprawozdawczy, jaka część NAV FRP jest objęta następującymi mechanizmami postępowania:	
	ograniczeniami	% NAV

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	zawieszeniem obrotu	% NAV
	opłatami płynnościowymi	% NAV
	innymi mechanizmami postępowaniami na potrzeby zarządzania aktywami niepłynnymi	rodzaj mechanizmu
		% NAV
(A.7.8)	Wartość aktywów netto FRP w okresie sprawozdawczym	(w EUR, w tym wpływ subskrypcji i umorzeń) (na ostatni dzień miesiąca)
	styczeń	
	luty	
	marzec	
	kwiecień	
	maj	
	czerwiec	
	lipiec	
	sierpień	
	wrzesień	
	październik	
	listopad	
	grudzień	
(A.7.9)	Subskrypcje w okresie sprawozdawczym	(w EUR)
	styczeń	
	luty	
	marzec	
	kwiecień	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	maj	
	czerwiec	
	lipiec	
	sierpień	
	wrzesień	
	październik	
	listopad	
	grudzień	
(A.7.10)	Umorzenia w okresie sprawozdawczym	(w EUR)
	styczeń	
	luty	
	marzec	
	kwiecień	
	maj	
	czerwiec	
	lipiec	
	sierpień	
	wrzesień	
	październik	
	listopad	
	grudzień	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(A.7.11)	Płatności na rzecz inwestorów	(w EUR)
	styczeń	
	luty	
	marzec	
	kwiecień	
	maj	
	czerwiec	
	lipiec	
	sierpień	
	wrzesień	
	październik	
	listopad	
	grudzień	
(A.7.12)	Kurs wymiany	
	styczeń	
	luty	
	marzec	
	kwiecień	
	maj	
	czerwiec	
	lipiec	
	sierpień	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	wrzesień	
	październik	
	listopad	
	grudzień	

**FRP o niskiej zmienności NAV**

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
---------	---------------	----------------

**(B) MAJĄCE ZASTOSOWANIE DO FRP O NISKIEJ ZMIENNOŚCI NAV**

	a) Proszę wskazać każde zdarzenie, w wyniku którego cena składnika aktywów wycenianego według metody kosztu zamortyzowanego zgodnie z art. 29 ust. 7 akapit pierwszy rozporządzenia (UE) 2017/1131 odbiegała od ceny tego składnika obliczonej zgodnie z art. 29 ust. 2, 3 i 4 rozporządzenia (UE) 2017/1131 o ponad 10 punktów bazowych. Pola te należy uzupełnić w odniesieniu do każdego składnika aktywów, w przypadku którego stwierdzono by taką rozbieżność ceny przy wycenie według metody kosztu zamortyzowanego.	
(B.1.1)	Data wyceny (pierwszy dzień, w którym zdarzenie miało miejsce)	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(B.1.2)	Kod ISIN danego składnika aktywów	kod ISIN zgodnie z ISO 6166, złożony z 12 znaków alfanumerycznych
(B.1.3)	Kod CFI (jeśli jest dostępny i jeżeli kod ISIN nie jest dostępny) składnika aktywów	kod CFI zgodnie z ISO 10692, złożony z 6 liter
(B.1.4)	Cena (art. 29 ust. 2, 3 i 4 rozporządzenia (UE) 2017/1131) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.1, kiedy zdarzenie miało miejsce)	
(B.1.5)	Cena (metoda kosztu zamortyzowanego) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.1 kiedy zdarzenie miało miejsce)	
(B.1.6)	Od daty wyceny wskazanej w polu B.1.1, wskazać jak długo cena składnika aktywów wycenianego według metody kosztu zamortyzowanego odbiegała o ponad 10 punktów bazowych od ceny tego składnika aktywów	(dni)
(B.1.7)	Proszę wskazać średnią różnicę pomiędzy dwoma wartościami wskazanymi w polu B.1.6 w okresie wskazanym w polu B.1.6	

Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
(B.1.8)	Proszę wskazać minimalną różnicę cen pomiędzy dwoma wartościami w okresie wskazanym w polu B.1.6	
(B.1.9)	Proszę wskazać maksymalną różnicę cen pomiędzy dwoma wartościami w okresie wskazanym w polu B.1.6	
	b) Proszę wskazać każde zdarzenie, w wyniku którego stała NAV przypadająca na jednostkę uczestnictwa lub udział obliczona zgodnie z art. 32 ust. 1 i 2 rozporządzenia (UE) 2017/1131 odbiegała od NAV przypadającej na jednostkę uczestnictwa lub udział obliczoną zgodnie z art. 30 rozporządzenia (UE) 2017/1131 o ponad 20 punktów bazowych.	
(B.1.10)	Data wyceny (pierwszy dzień, w którym zdarzenie miało miejsce)	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
(B.1.11)	Stała NAV (art. 31 rozporządzenia (UE) 2017/1131) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.10, kiedy zdarzenie miało miejsce)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(B.1.12)	Stała NAV (art. 31 rozporządzenia (UE) 2017/1131) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.10, kiedy zdarzenie miało miejsce)	(w walucie bazowej)
(B.1.13)	NAV (art. 30 rozporządzenia (UE) 2017/1131) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.10, kiedy zdarzenie miało miejsce)	(w EUR) (jeżeli walutą bazową nie jest EUR, stosowanym kursem wymiany jest ostatni kurs ustalony przez Europejski Bank Centralny)
(B.1.14)	NAV (art. 30 rozporządzenia (UE) 2017/1131) (na dzień wyceny wskazany w polu B.1.10, kiedy zdarzenie miało miejsce)	(w walucie bazowej)
(B.1.15)	Proszę wskazać, jak długo obliczona stała NAV przypadająca na jednostkę uczestnictwa lub udział odbiegała od obliczonej NAV przypadającej na jednostkę uczestnictwa lub udział o ponad 20 punktów bazowych od dnia wyceny wskazanego w polu B.1.10	(dni)
(B.1.16)	Proszę wskazać średnią różnicę między dwoma wartościami wskazanymi w polu B.1.15 w okresie wskazanym w polu B.1.15	
(B.1.17)	Proszę wskazać minimalną różnicę cen między dwoma wartościami w okresie wskazanym w polu B.1.15	
(B.1.18)	Proszę wskazać maksymalną różnicę cen między dwoma wartościami w okresie wskazanym w polu B.1.15	
	c) Proszę wskazać każde zdarzenie, podczas którego miała miejsce sytuacja określona w art. 34 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2017/1131, oraz środki podjęte przez zarząd zgodnie z art. 34 ust. 1 lit. a) i b) tego rozporządzenia.	
(B.1.19)	Data zdarzenia	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD

	Pozycja	Rodzaj danych	Zgłaszane dane
	(B.1.20)	Data podjęcia środka	data zgodnie z ISO 8601 w formacie RRRR-MM-DD
	(B.1.21)	Rodzaj środka (podejmowanego gdy odsetek aktywów o tygodniowym terminie zapadalności spada poniżej 30 % ogółu aktywów FRP oraz gdy umorzeniaienne netto w pojedynczym dniu roboczym przekroczą 10 % ogółu aktywów)	opłaty płynnościowe w przypadku umorzeń ograniczenia dotyczące umorzeń zawieszenie realizacji umorzeń brak natychmiastowych działań poza zaradzeniem sytuacji, w przypadku przekroczenia ograniczeń, o których mowa w art. 24 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/1131, zgodnie z art. 24 ust. 2 tego rozporządzenia
	(B.1.22)	Rodzaj środka (podejmowanego gdy odsetek aktywów o tygodniowym terminie zapadalności spada poniżej 10 % ogółu aktywów FRP)	opłaty płynnościowe w przypadku umorzeń zawieszenie realizacji umorzeń