

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ IV

Υποδείγματα εκθέσεων: ΔΟΕΕ

[άρθρο 3 παράγραφος 3 στοιχείο δ) και άρθρο 24 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ]

Υποβολή εκθέσεων με πληροφορίες ειδικά για τον ΔΟΕΕ

[άρθρο 3 παράγραφος 3 στοιχείο δ) και άρθρο 24 παράγραφος 1 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ]

		Σημαντικότερη αγορά/μέσο	Δεύτερη σημαντικότερη αγορά/μέσο	Τρίτη σημαντικότερη αγορά/μέσο	Τέταρτη σημαντικότερη αγορά/μέσο	Πέμπτη σημαντικότερη αγορά/μέσο
1	Βασικές αγορές στις οποίες πραγματοποιεί εμπορικές συναλλαγές για λογαριασμό των ΟΕΕ που διαχειρίζεται					
2	Βασικά μέσα στα οποία πραγματοποιεί εμπορικές συναλλαγές για λογαριασμό των ΟΕΕ που διαχειρίζεται					
3	Αξίες των υπό διαχείριση περιουσιακών στοιχείων για όλους τους υπό διαχείριση ΟΕΕ, υπολογιζόμενες όπως ορίζεται στο άρθρο 2	Στο βασικό νόμισμα (εάν είναι το ίδιο για όλους τους ΟΕΕ)		Σε ευρώ		
	Παρακαλούμε αναφέρετε την επίσημη ονομασία, την τοποθεσία και τη δικαιοδοσία των αγορών					

Αναλυτικός κατάλογος όλων των ΟΕΕ που διαχειρίζεται ο ΔΟΕΕ

παρέχεται κατόπιν αιτήματος στη λήξη κάθε τριμήνου

(άρθρο 24 παράγραφος 3 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ)

Ονομασία του ΟΕΕ	Κωδικός ταυτοποίησης οργανισμού						Ημερομηνία έναρξης	Είδος ΟΕΕ [οργανισμός που επενδύει σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου, μετοχές μη διαπραγματεύσιμες ή ακίνητα, οργανισμός που επενδύσει σε άλλους οργανισμούς (fund of funds), άλλος οργανισμός (*)]	ΚΑΕ	ΕΝΤΟΣ ΕΕ ΟΕΕ: Ναι/Όχι

(*) Εάν πρόκειται για άλλο είδος οργανισμού, παρακαλούμε αναφέρετε τη στρατηγική που περιγράφει καλύτερα το είδος του ΟΕΕ.

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.

Υποδείγματα εκθέσεων: ΟΕΕ

[άρθρο 3 παράγραφος 3 στοιχείο δ) και άρθρο 24 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ]

Παροχή πληροφοριών ειδικά για τον ΟΕΕ

[άρθρο 3 παράγραφος 3 στοιχείο δ) και άρθρο 24 παράγραφος 1 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ]

Τύπος δεδομένων			Αναφερόμενα δεδομένα	
Ταυτοποίηση του ΟΕΕ				
1	Όνομασία του ΟΕΕ		ΕΝΤΟΣ ΕΕ ΟΕΕ: ναι/όχι	
2	Διαχειριστής κεφαλαίων (Νόμιμη ονομασία και τυποποιημένος κωδικός, εάν είναι διαθέσιμος)		ΕΝΤΟΣ ΕΕ ΔΟΕΕ: ναι/όχι	
3	Κωδικοί ταυτοποίησης οργανισμού, κατά περίπτωση			
4	Ημερομηνία έναρξης του ΟΕΕ			
5	Έδρα του ΟΕΕ			
6	Ταυτοποίηση του βασικού μεσίτη (των βασικών μεσιτών) του ΟΕΕ (Νόμιμη ονομασία και τυποποιημένος κωδικός, εάν είναι διαθέσιμος)			
7	Βασικό νόμισμα του ΟΕΕ σύμφωνα με το ISO 4217 και υπό διαχείριση περιουσιακά στοιχεία, υπολογιζόμενα όπως ορίζεται στο άρθρο 2		Νόμισμα	Σύνολο ΥΔΠΣ
8	Τομείς δικαιοδοσίας των τριών βασικών πηγών χρηματοδότησης (εξαιρουμένων των μετοχών/μεριδίων του ΟΕΕ που αγοράζουν επενδυτές)			
9	Κυρίαρχο είδος ΟΕΕ (επιλέξτε ένα)		Οργανισμός που επενδύει σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου Οργανισμός που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες Οργανισμός που επενδύσει σε ακίνητα Οργανισμός που επενδύει σε άλλους οργανισμούς (Fund of Funds) Άλλο Κανένα	
10	Ανάλυση επενδυτικών στρατηγικών (Αναφέρετε ανάλυση των επενδυτικών στρατηγικών του ΟΕΕ ανάλογα με το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ που επιλέξατε για το ερώτημα 1. Ανατρέξτε στις επεξηγηματικές σημειώσεις για περαιτέρω πληροφορίες σχετικά με τον τρόπο συμπλήρωσης του παρόντος ερωτήματος.)			

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
		Αναφέρετε τη στρατηγική που περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ	Συμμετοχή στην ΚΑΕ (%)
α) Στρατηγικές οργανισμών που επενδύουν σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύει σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1.)			
Αναφέρετε τη στρατηγική επενδύσεων σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου που περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ Μετοχές: Long Bias Μετοχές: Long/Short Μετοχές: Ουδέτερη έκθεση στο κίνδυνο αγοράς Μετοχές: Short Bias Σχετική αξία: Αρμπιτράζ σταθερού εισοδήματος Σχετική αξία: Αρμπιτράζ μετατρέψιμων ομολόγων Σχετική αξία: Αρμπιτράζ μεταβλητότητας Λόγω επέλευσης γεγονότων: Επείγον/Αναδιάρθρωση Λόγω επέλευσης γεγονότων: Αρμπιτράζ κινδύνου/Αρμπιτράζ συγχώνευσης Λόγω επέλευσης γεγονότων: Ειδικές περιπτώσεις μετοχών Πίστωση θετική/αρνητική Δανειοδότηση βάσει περιουσιακών στοιχείων Macro Διαχειριζόμενα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/CTA: Θεμελιώδη Διαχειριζόμενα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης/CTA: Ποσοτικά Οργανισμός που επενδύει σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου ο οποίος εφαρμόζει πολλαπλές στρατηγικές Άλλη στρατηγική οργανισμού που επενδύει σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου			
β) Στρατηγικές οργανισμών που επενδύουν σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1.)			
Αναφέρετε τη στρατηγική επενδύσεων σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες που περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ Κεφάλαια επιχειρηματικών συμμετοχών Κεφάλαια ανάπτυξης Κεφάλαια ενδιάμεσης χρηματοδότησης Οργανισμός που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες και εφαρμόζει πολλαπλές στρατηγικές Άλλη στρατηγική οργανισμού που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες			

Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
γ) Στρατηγικές οργανισμών που επενδύουν σε ακίνητα (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύει σε ακίνητα» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1.)		
Αναφέρετε τη στρατηγική επενδύσεων σε ακίνητα που περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ Οικιστικά ακίνητα Εμπορικά ακίνητα Βιομηχανικά ακίνητα Οργανισμός που επενδύει σε ακίνητα και εφαρμόζει πολλαπλές στρατηγικές Άλλη στρατηγική οργανισμού που επενδύει σε ακίνητα		
δ) Στρατηγικές οργανισμών που επενδύουν σε άλλους οργανισμούς (Fund of Funds) (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύει σε άλλους οργανισμούς (Fund of Funds)» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1.)		
Αναφέρετε τη στρατηγική επενδύσεων «οργανισμών που επενδύουν σε άλλους οργανισμούς» η οποία περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ Οργανισμός που επενδύει σε οργανισμούς οι οποίοι επενδύουν σε κεφάλαια αντιστάθμισης κινδύνου Οργανισμός που επενδύει σε οργανισμούς οι οποίοι επενδύουν σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες Οργανισμός που επενδύει σε άλλα είδη οργανισμών		
ε) Άλλες στρατηγικές (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Άλλο» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1.)		
Αναφέρετε την «άλλη» στρατηγική που περιγράφει καλύτερα τη στρατηγική του ΟΕΕ Οργανισμός που επενδύει σε εμπορεύματα Οργανισμός που επενδύει σε μετοχές Οργανισμός που πραγματοποιεί επενδύσεις σταθερού εισοδήματος Οργανισμός που επενδύει σε υποδομές Άλλος οργανισμός		

Τύπος δεδομένων				Αναφερόμενα δεδομένα	
Βασικές εκθέσεις και σημαντικότερη συγκέντρωση					
11	Βασικά μέσα στα οποία πραγματοποιεί εμπορικές συναλλαγές ο ΟΕΕ				
		Τύπος μέσου/κωδικός μέσου	Αξία (υπολογιζόμενη βάσει του άρθρου 3 της ΟΔΟΕΕ)	Θετική/αρνητική θέση	
	Σημαντικότερο μέσο				
	2ο σημαντικότερο μέσο				
	3ο σημαντικότερο μέσο				
	4ο σημαντικότερο μέσο				
	5ο σημαντικότερο μέσο				
12	Γεωγραφική περιοχή δραστηριοποίησης				
	Αναφέρετε γεωγραφική ανάλυση των επενδύσεων που κατέχει ο ΟΕΕ με το αντίστοιχο ποσοστό επί της συνολικής καθαρής αξίας ενεργητικού του ΟΕΕ			% της ΚΑΕ	
	Αφρική				
	Ασία και Ειρηνικός (εκτός Μέσης Ανατολής)				
	Ευρώπη (ΕΟΧ)				
	Ευρώπη (εκτός ΕΟΧ)				
	Μέση Ανατολή				
	Βόρεια Αμερική				
	Νότια Αμερική				
	Υπερεθνική περιοχή/πολλές περιοχές				

Τύπος δεδομένων					Αναφερόμενα δεδομένα		
13	10 βασικές εκθέσεις του ΟΕΕ κατά την ημερομηνία υποβολής της έκθεσης (οι πλέον πολύτιμες σε απόλυτες τιμές):						
		Είδος περιουσιακού στοιχείου/υποχρέωσης	Ονομασία/περιγραφή του στοιχείου/της υποχρέωσης	Αξία (υπολογιζόμενη βάσει του άρθρου 3)	% της ακαθάριστης αγοραίας αξίας	Θετική/αρνητική θέση	Αντισυμβαλλόμενος (κατά περίπτωση)
	1η						
	2η						
	3η						
	4η						
	5η						
	6η						
	7η						
	8η						
	9η						
	10η						
14	5 σημαντικότερες συγκεντρώσεις χαρτοφυλακίων:						
		Είδος περιουσιακού στοιχείου/υποχρέωσης	Ονομασία/περιγραφή της αγοράς	Αξία της αθροιστικής έκθεσης (υπολογιζόμενη βάσει του άρθρου 3)	% της ακαθάριστης αγοραίας αξίας	Θετική/αρνητική θέση	Αντισυμβαλλόμενος (κατά περίπτωση)
	1η						
	2η						
	3η						
	4η						
	5η						

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
15	Τυπικό μέγεθος της συναλλαγής/θέσης (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ στο ερώτημα 1)	[Επιλέξτε] Πολύ μικρό Μικρό Κατώτερη μέση αγορά Ανώτερη μέση αγορά Υψηλή κεφαλαιοποίηση Πολύ υψηλή κεφαλαιοποίηση	
16	Βασικές αγορές στις οποίες πραγματοποιεί εμπορικές συναλλαγές ο ΟΕΕ		
	Παρακαλούμε αναφέρετε την ονομασία και τον κωδικό αναγνώρισης (π.χ. τον κωδικό MIC), εάν είναι διαθέσιμος, της αγοράς με τη μεγαλύτερη έκθεση		
	Παρακαλούμε αναφέρετε την ονομασία και τον κωδικό αναγνώρισης (π.χ. τον κωδικό MIC), εάν είναι διαθέσιμος, της αγοράς με τη δεύτερη μεγαλύτερη έκθεση		
	Παρακαλούμε αναφέρετε την ονομασία και τον κωδικό αναγνώρισης (π.χ. τον κωδικό MIC), εάν είναι διαθέσιμος, της αγοράς με την τρίτη μεγαλύτερη έκθεση		
17	Συγκέντρωση επενδυτών		
	Αναφέρετε το κατά προσέγγιση ποσοστό των μετοχών του ΟΕΕ των οποίων την πλήρη κυριότητα έχουν οι πέντε κάτοχοι με τη μεγαλύτερη συμμετοχή στο μετοχικό κεφάλαιο του ΟΕΕ (ως ποσοστού των μετοχών/μεριδίων του ΟΕΕ σε κυκλοφορία· αναζήτηση των κατόχων πραγματικής κυριότητας όταν αυτό είναι γνωστό ή εφικτό)		
	Ανάλυση της συγκέντρωσης επενδυτών ανά κατάσταση επενδυτή (τεκμαρτής, εάν δεν υπάρχουν διαθέσιμα ακριβή στοιχεία):	%	
	— Επαγγελματίες πελάτες (βάσει του σχετικού ορισμού που περιλαμβάνεται στην οδηγία 2004/39/EK) — Ευρύ επενδυτικό κοινό:		

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.

Παροχή πληροφοριών στις αρμόδιες αρχές ειδικά για τον ΟΕΕ

(άρθρο 24 παράγραφος 2 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ)

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
Ταυτοποίηση του ΟΕΕ			
1	Ονομασία του ΟΕΕ	ΕΝΤΟΣ ΕΕ ΟΕΕ: ναι/όχι	
2	Διαχειριστής κεφαλαίων	ΕΝΤΟΣ ΕΕ ΔΟΕΕ: ναι/όχι	
1	Ονομασία του ΟΕΕ		
2	Διαχειριστής κεφαλαίων		
3	Κωδικοί ταυτοποίησης οργανισμού, κατά περίπτωση		
4	Ημερομηνία έναρξης του ΟΕΕ		
5	Βασικό νόμισμα του ΟΕΕ σύμφωνα με το ISO 4217 και υπό διαχείριση περιουσιακά στοιχεία, υπολογιζόμενα όπως ορίζεται στο άρθρο 2	Νόμισμα	Σύνολο ΥΔΠΣ
6	Ταυτοποίηση του βασικού μεσίτη (των βασικών μεσιτών) του ΟΕΕ		
7	Τομείς δικαιοδοσίας των τριών βασικών πηγών χρηματοδότησης		
Μέσα στα οποία πραγματοποιούνται συναλλαγές και επιμέρους εκθέσεις			
8	Επιμέρους εκθέσεις στις οποίες πραγματοποιεί εμπορικές συναλλαγές και οι βασικές κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων στα οποία έχει επενδύσει ο ΟΕΕ έως και την ημερομηνία της έκθεσης:		
	α) Τίτλοι		Θετική αξία Αρνητική αξία
	Ταμειακά διαθέσιμα και ισοδύναμα		
	Εκ των οποίων:	Πιστοποιητικά καταθέσεων	
		Εμπορικά χρεόγραφα	
		Άλλες καταθέσεις	
		Άλλα ταμειακά διαθέσιμα και ισοδύναμα (εκτός κρατικών τίτλων)	
	Εισηγμένες μετοχές		
	Εκ των οποίων:	Εκδοθείσες από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα	
		Άλλες εισηγμένες μετοχές	
	Μη εισηγμένες μετοχές		
	Εταιρικά ομόλογα μη εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα		
	Εκ των οποίων:	Επενδυτικού βαθμού	

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
	Μη επενδυτικού βαθμού		
Εταιρικά ομόλογα εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα			
Εκ των οποίων:	Επενδυτικού βαθμού		
	Μη επενδυτικού βαθμού		
Κρατικά ομόλογα			
Εκ των οποίων:	Ομόλογα ΕΕ με διάρκεια 0-1 έτους μέχρι τη ληκτότητα		
	Ομόλογα ΕΕ με διάρκεια 1 + έτους μέχρι τη ληκτότητα		
	Ομόλογα εκτός G10 με διάρκεια 0-1 έτους μέχρι τη ληκτότητα		
	Ομόλογα εκτός G10 με διάρκεια 1 + έτους μέχρι τη ληκτότητα		
Μετατρέψιμα ομόλογα μη εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα			
Εκ των οποίων:	Επενδυτικού βαθμού		
	Μη επενδυτικού βαθμού		
Μετατρέψιμα ομόλογα εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα			
Εκ των οποίων:	Επενδυτικού βαθμού		
	Μη επενδυτικού βαθμού		

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
Δάνεια			
Εκ των οποίων:	Μοχλευμένα δάνεια		
	Άλλα δάνεια		
Δομημένα/τιτλοποιημένα προϊόντα			
Εκ των οποίων:	ABS		
	RMBS		
	CMBS		
	Agency MBS		
	ABCP		
	CDO/CLO		
	Δομημένα πιστοποιητικά		
	ETP		
	Άλλο		
β) Παράγωγα		Θετική αξία	Αρνητική αξία
Παράγωγα επί μετοχών			
Εκ των οποίων:	Σχετιζόμενα με χρηματοπιστωτικά ιδρύματα		
	Άλλα παράγωγα επί μετοχών		

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
Παράγωγα σταθερού εισοδήματος			
CDS			
Εκ των οποίων:	Χρηματοοικονομικά CDS μεμονωμένου πιστούχου		
	Κρατικά CDS μεμονωμένου πιστούχου		
	Άλλα CDS μεμονωμένου πιστούχου		
	CDS επί δεικτών		
	Εξωτικά (συμπεριλαμβανομένου του τμήματος κινδύνου αθέτησης)		
		Ακαθάριστη αξία	
Συνάλλαγμα (για επενδυτικούς σκοπούς)			
Παράγωγα επιτοκίων			
		Θετική αξία	Αρνητική αξία
Παράγωγα επί εμπορευμάτων			
Εκ των οποίων:	Ενέργεια		
	Εκ των οποίων:		
	— Αργό πετρέλαιο		
	— Φυσικό αέριο		
	— Ηλεκτρική ενέργεια		
	Πολύτιμα μέταλλα		
	Εκ των οποίων: Χρυσός		
	Άλλα εμπορεύματα		
	Εκ των οποίων:		
	— Βιομηχανικά μέταλλα		
	— Ζωικό κεφάλαιο		

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
	— Αγροτικά προϊόντα		
Άλλα παράγωγα			
γ) Φυσικά (πραγματικά/ενσώματα) περιουσιακά στοιχεία		Θετική αξία	
Φυσικά: Ακίνητα			
Εκ των οποίων:	Οικιστικά ακίνητα		
	Εμπορικά ακίνητα		
Φυσικά: Εμπορεύματα			
Φυσικά: Ξυλεία			
Φυσικά: Έργα τέχνης και είδη προς συλλογή			
Φυσικά: Μεταφορικά μέσα			
Φυσικά: Άλλα			
δ) Εταιρείες συλλογικών επενδύσεων		Θετική αξία	
Επενδύσεις σε ΕΣΕ που τελούν υπό τη λειτουργία/διαχείριση του ΔΟΕΕ			
Εκ των οποίων:	Οργανισμοί χρηματαγορών και ΕΣΕ διαχείρισης ταμειακών ροών		
	ΕΙΕΕ		
	Άλλες ΕΣΕ		
Επενδύσεις σε ΕΣΕ που δεν τελούν υπό τη λειτουργία/διαχείριση του ΔΟΕΕ			
Εκ των οποίων:	Οργανισμοί χρηματαγορών και ΕΣΕ διαχείρισης ταμειακών ροών		
	ΕΙΕΕ		

	Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
		Άλλες ΕΣΕ		
	ε) Επενδύσεις σε άλλες κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων		Θετική αξία	Αρνητική αξία
	Σύνολο «άλλα»			
9	Αξία κύκλου εργασιών σε κάθε κατηγορία περιουσιακών στοιχείων για τους μήνες αναφοράς			
	α) Τίτλοι		Αγοραία αξία	
	Ταμειακά διαθέσιμα και ισοδύναμα			
	Εισηγμένες μετοχές			
	Μη εισηγμένες μετοχές			
	Εταιρικά ομόλογα μη εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα			
	Εκ των οποίων:	Επενδυτικού βαθμού		
		Μη επενδυτικού βαθμού		
	Εταιρικά ομόλογα εκδοθέντα από χρηματοπιστωτικά ιδρύματα			
	Κρατικά ομόλογα			
	Εκ των οποίων:	Ομόλογα κράτους μέλους της ΕΕ		
		Ομόλογα μη κράτους μέλους της ΕΕ		
	Μετατρέψιμα ομόλογα:			
	Δάνεια			
	Δομημένα/τιτλοποιημένα προϊόντα			

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
		Ονομαστική αξία	Αγοραία αξία
β) Παράγωγα			
Παράγωγα επί μετοχών			
Παράγωγα σταθερού εισοδήματος			
CDS			
Συνάλλαγμα (για επενδυτικούς σκοπούς)			
Παράγωγα επιτοκίων			
Παράγωγα επί εμπορευμάτων			
Άλλα παράγωγα			
γ) Φυσικά (πραγματικά/ενσώματα) περιουσιακά στοιχεία		Αγοραία αξία	
Φυσικά: Εμπορεύματα			
Φυσικά: Ακίνητα			
Φυσικά: Ξυλεία			
Φυσικά: Έργα τέχνης και είδη προς συλλογή			
Φυσικά: Μεταφορικά μέσα			
Φυσικά: Άλλα			
δ) Εταιρείες συλλογικών επενδύσεων			
ε) Άλλες κατηγορίες περιουσιακών στοιχείων			
Νόμισμα των εκθέσεων			

	Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
10	Συνολική αρνητική και θετική αξία των εκθέσεων (πριν από την αντιστάθμιση συναλλαγματικού κινδύνου) από τις ακόλουθες ομάδες συναλλάγματος:		Θετική αξία	Αρνητική αξία
	AUD			
	CAD			
	CHF			
	EUR			
	GBP			
	HKD			
	JPY			
	USD			
	Other			
11	Τυπικό μέγεθος της συναλλαγής/θέσης (Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «Οργανισμός που επενδύσει σε μετοχές μη διαπραγματεύσιμες» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ ανωτέρω)		[Επιλέξτε] Πολύ μικρό (< 5 εκατ. ευρώ) Μικρό (5 εκατ. ευρώ έως < 25 εκατ. ευρώ) Κατώτερη/μέση αγορά (25 εκατ. ευρώ έως < 150 εκατ. ευρώ) Ανώτερη/μέση αγορά (150 εκατ. ευρώ έως 500 εκατ. ευρώ) Υψηλή κεφαλαιοποίηση (500 εκατ. ευρώ έως 1 δις ευρώ) Πολύ υψηλή κεφαλαιοποίηση (1 δις ευρώ και άνω)	

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
12	Κυριαρχική επιρροή [βλέπε άρθρο 1 της οδηγίας 83/349/ΕΟΚ του Συμβουλίου (ΕΕ L 193 της 18.7.1983, σ. 1)] [Συμπληρώστε το παρόν ερώτημα εάν επιλέξατε «οργανισμός που επενδύει σε μετοχές μη διαπραγματευσιμες» για το κυρίαρχο είδος ΟΕΕ ανωτέρω· παρακαλούμε συμπληρώστε για κάθε εταιρεία επί της οποίας ο ΟΕΕ ασκεί κυριαρχική επιρροή (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν υπάρχει ελεγκτική επιρροή), όπως ορίζεται στο άρθρο 1 της οδηγίας 83/349/ΕΟΚ]	Ονομασία	% δικαιωμάτων ψήφου Είδος συναλλαγής
Προφίλ κινδύνων του ΟΕΕ			
	1. Προφίλ κινδύνου αγοράς		
13	Αναμενόμενη ετήσια απόδοση/ΣΕΑ υπό κανονικές συνθήκες αγοράς (σε %)		
	Καθαρό δέλτα μετοχής		
	Καθαρό DV01:		
	Καθαρό CS01:		
	2. Προφίλ κινδύνου αντισυμβαλλομένου		
14	Μηχανισμοί διαπραγμάτευσης και εκκαθάρισης		
	α) Υπολογιζόμενο % (βάσει αγοραίας αξίας) των τίτλων που τέθηκαν υπό διαπραγμάτευση: (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν υπάρχουν τίτλοι υπό διαπραγμάτευση)	%	
	Σε ρυθμιζόμενο χρηματιστήριο		
	Εκτός χρηματιστηρίου		
	β) Υπολογιζόμενο % (βάσει όγκων διαπραγματεύσεων) των παραγώγων που τέθηκαν υπό διαπραγμάτευση: (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν υπάρχουν παράγωγα υπό διαπραγμάτευση)	%	
	Σε ρυθμιζόμενο χρηματιστήριο		
	Εκτός χρηματιστηρίου		

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
	γ) Υπολογιζόμενο % (βάσει όγκων διαπραγματεύσεων) των παραγώγων που τέθηκαν υπό εκκαθάριση: (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν υπάρχουν παράγωγα υπό διαπραγμάτευση)	%	
	Από κεντρικό αντισυμβαλλόμενο		
	Διμερώς		
	δ) Υπολογιζόμενο % (βάσει αγοραίας αξίας) των συναλλαγών πώλησης και επαναγοράς που τέθηκαν υπό εκκαθάριση: (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν υπάρχουν συναλλαγές πώλησης και επαναγοράς υπό διαπραγμάτευση)	%	
	Από κεντρικό αντισυμβαλλόμενο		
	Διμερώς		
	Τριμερώς		
15	Αξία ασφαλειών και άλλης πιστωτικής στήριξης που έχει παράσχει ο ΟΕΕ σε όλους τους αντισυμβαλλομένους		
	α) Αξία ασφαλειών που παρασχέθηκαν υπό τη μορφή ταμειακών διαθεσίμων και ισοδυνάμων		
	β) Αξία ασφαλειών που παρασχέθηκαν υπό τη μορφή άλλων τίτλων (εκτός ταμειακών διαθεσίμων και ισοδυνάμων)		
	γ) Αξία άλλων ασφαλειών και άλλων μορφών πιστωτικής υποστήριξης που παρασχέθηκαν (συμπεριλαμβανομένου του ονομαστικού ποσού εγγυητικών επιστολών και παρόμοιων μορφών πιστωτικής στήριξης τρίτων)		
16	Από το ποσό των ασφαλειών και άλλων μορφών πιστωτικής στήριξης που έχει παράσχει ο αναφέρων οργανισμός σε αντισυμβαλλομένους: τι ποσοστό έχει επανυποθηκευτεί από τους αντισυμβαλλομένους;		
17	Ανώτατες πέντε εκθέσεις σε αντισυμβαλλομένους (εκτός κεντρικών αντισυμβαλλομένων)		
	α) Αναφέρετε τους πέντε ανώτερους αντισυμβαλλομένους στους οποίους ο ΟΕΕ έχει την υψηλότερη τρέχουσα καθαρή πιστωτική έκθεση, μετρούμενη ως ποσοστό της ΚΑΕ του ΟΕΕ	Ονομασία	Συνολική έκθεση
	Αντισυμβαλλόμενος 1		

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
	Αντισυμβαλλόμενος 2		
	Αντισυμβαλλόμενος 3		
	Αντισυμβαλλόμενος 4		
	Αντισυμβαλλόμενος 5		
	β) Αναφέρετε τους πέντε ανώτερους αντισυμβαλλομένους οι οποίοι έχουν την υψηλότερη τρέχουσα καθαρή πιστωτική έκθεση στον ΟΕΕ, μετρούμενη ως ποσοστό της ΚΑΕ του ΟΕΕ	Ονομασία	Συνολική έκθεση
	Αντισυμβαλλόμενος 1		
	Αντισυμβαλλόμενος 2		
	Αντισυμβαλλόμενος 3		
	Αντισυμβαλλόμενος 4		
	Αντισυμβαλλόμενος 5		
18	Άμεση εκκαθάριση μέσω κεντρικών εκκαθαριζόντων αντισυμβαλλομένων		
	α) Κατά την περίοδο αναφοράς, προέβη ο ΟΕΕ σε εκκαθάριση οποιωνδήποτε συναλλαγών άμεσα μέσω κεντρικού αντισυμβαλλομένου;	Ναι Όχι (αν όχι, παραλείψτε το υπόλοιπο του ερωτήματος και προχωρήστε στο ερώτημα 21)	
	β) Αν απαντήσατε «ναι» στο ερώτημα 18 α), αναφέρετε τους πέντε ανώτερους κεντρικούς εκκαθαρίζοντες αντισυμβαλλομένους βάσει της καθαρής πιστωτικής έκθεσης	Ονομασία	Κατεχόμενη αξία
	Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος 1 (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν ισχύει)		
	Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος 2 (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν ισχύει)		
	Κεντρικός αντισυμβαλλόμενος 3 (αφήστε το πεδίο κενό εάν δεν ισχύει)		
	3. Προφίλ ρευστότητας		
	Προφίλ ρευστότητας χαρτοφυλακίου		

		Τύπος δεδομένων						Αναφερόμενα δεδομένα	
19	Προφίλ ρευστότητας επενδυτών Ποσοστό του χαρτοφυλακίου που δύναται να ρευστοποιηθεί εντός:								
	1 ημέρας ή μικρότερου διαστήματος	2-7 ημερών	8-30 ημερών	31-90 ημερών	91-180 ημερών	181-365 ημερών	άνω των 365 ημερών		
20	Αξία ταμειακών διαθεσίμων χωρίς βάρη								
	Προφίλ ρευστότητας επενδυτών								
21	Προφίλ ρευστότητας επενδυτών Ποσοστό μετοχών επενδυτών που μπορούν να εξοφληθούν εντός (ως % της ΚΑΕ του ΟΕΕ)								
	1 ημέρας ή μικρότερου διαστήματος	2-7 ημερών	8-30 ημερών	31-90 ημερών	91-180 ημερών	181-365 ημερών	άνω των 365 ημερών		
22	Εξοφλήσεις επενδυτών								
	α) Παρέχει ο ΟΕΕ στους επενδυτές δικαιώματα απόσυρσης/εξόφλησης κατά τη συνήθη εξέλιξη των πραγμάτων;						Ναι	Όχι	
	β) Ποια είναι η συχνότητα εξοφλήσεων από επενδυτές (σε περίπτωση πολλαπλών κατηγοριών μετοχών/μεριδίων, αναφέρετε τη μεγαλύτερη κατηγορία μετοχών της ΚΑΕ)						[Επιλέξτε] Ανά ημέρα Ανά εβδομάδα Ανά δεκαπενθήμερο Ανά μήνα Ανά τρίμηνο Ανά εξάμηνο Ανά έτος Άλλο Δεν ισχύει		
	γ) Ποια είναι η περίοδος προειδοποίησης σε ημέρες που απαιτείται για εξοφλήσεις από επενδυτές (αναφέρετε τη βάση περιουσιακών στοιχείων σταθμισμένη περίοδο προειδοποίησης σε περίπτωση πολλαπλών κατηγοριών μετοχών/μεριδίων)								

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
	δ) Ποια είναι η περίοδος «κλειδώματος» επενδυτών σε ημέρες (αναφέρετε τη βάση περιουσιακών στοιχείων σταθμισμένη περίοδο προειδοποίησης σε περίπτωση πολλαπλών κατηγοριών μετοχών/μεριδίων)		
23	Ειδικοί διακανονισμοί και προνομιακή μεταχείριση		
	α) Κατά την ημερομηνία αναφοράς, τι ποσοστό της ΚΑΕ του ΟΕΕ υπόκειται στους κατωτέρω διακανονισμούς:	% της ΚΑΕ	
	«Παράπλευρα ανεξάρτητα χαρτοφυλάκια» (side-pockets)		
	Πύλες		
	Αναστολή διαπραγμάτευσης		
	Άλλοι διακανονισμοί για τη διαχείριση μη ρευστοποιήσιμων περιουσιακών στοιχείων (παρακαλούμε προσδιορίστε)	[Τύπος]	[%]
	β) Αναφέρετε το ποσοστό της καθαρής αξίας ενεργητικού των περιουσιακών στοιχείων του ΟΕΕ που υπόκεινται τώρα σε ειδικούς διακανονισμούς οι οποίοι προκύπτουν από τη μη ρευστοποιήσιμη φύση τους βάσει του στοιχείου α) του άρθρου 23 παράγραφος 4 της ΟΔΟΕΕ, συμπεριλαμβανομένων και εκείνων που αναφέρονται στο ερώτημα 25(α).		
	Ειδικοί διακανονισμοί ως % της ΚΑΕ		
	γ) Υπάρχουν τυχόν επενδυτές που εξασφαλίζουν προνομιακή μεταχείριση ή το δικαίωμα προνομιακής μεταχείρισης (π.χ. μέσω συνοδευτικής επιστολής) και ως εκ τούτου υπόκεινται σε υποχρέωση παροχής πληροφοριών σε εκείνους που επενδύουν στον ΟΕΕ βάσει του στοιχείου ι) του άρθρου 23 παράγραφος 1 της ΟΔΟΕΕ;	(Ναι ή όχι)	
	δ) Εάν απαντήσατε «ναι» στο στοιχείο γ), παρακαλούμε αναφέρετε όλες τις σχετικές μορφές προνομιακής μεταχείρισης:		
	Αναφορικά με διαφορετική παροχή πληροφοριών/υποβολή εκθέσεων στους επενδυτές		
	Αναφορικά με διαφορετικούς όρους ρευστότητας για τους επενδυτές		
	Αναφορικά με διαφορετικούς όρους αμοιβών για τους επενδυτές		
	Άλλη μορφή προνομιακής μεταχείρισης πλην των ανωτέρω		

	Τύπος δεδομένων						Αναφερόμενα δεδομένα	
24	Αναφέρετε την ανάλυση των ποσοστών κυριότητας μεριδίων στον ΟΕΕ ανά ομάδα επενδυτών (ως % της ΚΑΕ των περιουσιακών στοιχείων του ΟΕΕ· αναζήτηση των κατόχων πραγματικής κυριότητας όταν αυτό είναι γνωστό ή εφικτό)							
25	Ρευστότητα χρηματοδότησης							
	α) Αναφέρετε το συνολικό ποσό δανείων και χρηματοδοτήσεων σε μετρητά που είναι διαθέσιμα για τον ΟΕΕ (συμπεριλαμβανομένων εκείνων που έχουν και εκείνων που δεν έχουν ληφθεί, και των μη δεσμευμένων πιστωτικών ορίων, καθώς και οποιονδήποτε όρων δανεισμού)							
	β) Επιμερίστε το ποσό που αναφέρθηκε στο στοιχείο α) στις κατωτέρω περιόδους βάσει της μεγαλύτερης περιόδου για την οποία ο πιστωτής δεσμεύεται συμβατικά να παράσχει την εν λόγω χρηματοδότηση:							
	1 ημέρα ή μικρότερο διάστημα	2-7 ημέρες	8-30 ημέρες	31-90 ημέρες	91-180 ημέρες	181-365 ημέρες	άνω των 365 ημερών	
	4. Κίνδυνος δανεισμού και έκθεσης							
26	Αξία δανείων σε μετρητά ή τίτλους που αντιπροσωπεύεται από:							
	Ανασφάλιστα δάνεια σε μετρητά							
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω βασικού μεσίτη:							
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω συμφωνίας πώλησης και επαναγοράς (αγοράς και επαναπώλησης):							
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω άλλου:							
27	Αξία δανείων ενσωματωμένων σε χρηματοοικονομικά μέσα							
	Παράγωγα που τελούν υπό διαπραγμάτευση σε χρηματιστήριο: Ακαθάριστη έκθεση μείον το παρεχόμενο περιθώριο ασφαλείας							
	Εξωχρηματιστηριακά παράγωγα: Ακαθάριστη έκθεση μείον το παρεχόμενο περιθώριο ασφαλείας							

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
28	Αξία τίτλων που ελήφθησαν ως δάνειο για αρνητικές θέσεις		
29	Ακαθάριστη έκθεση χρηματοοικονομικών και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομικών δομών που ελέγχονται από τον ΟΕΕ, όπως ορίζεται στην αιτιολογική σκέψη 78 της ΟΔΟΕΕ		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	...		
30	Μόχλευση του ΟΕΕ		
	α) υπολογιζόμενη με τη μέθοδο βάσει των ακαθάριστων αξιών		
	β) υπολογιζόμενη με τη μέθοδο βάσει των ακαθάριστων δεσμεύσεων		
	5. Λειτουργικοί και άλλοι κίνδυνοι		
31	Συνολικός αριθμός ανοιχτών θέσεων		
32	Προφίλ ιστορικού κινδύνων		
	α) Ακαθάριστες αποδόσεις επενδύσεων ή εσωτερικός συντελεστής απόδοσης (ΕΣΑ) του ΟΕΕ κατά την περίοδο αναφοράς (ως %, συμπεριλαμβανομένων των διαχειριστικών αμοιβών και των αμοιβών απόδοσης)		
	1ος μήνας της περιόδου αναφοράς		
	2ος μήνας της περιόδου αναφοράς		
	...		
	...		
	Τελευταίος μήνας της περιόδου αναφοράς		
	β) Καθαρές αποδόσεις επενδύσεων ή εσωτερικός συντελεστής απόδοσης (ΕΣΑ) του ΟΕΕ κατά την περίοδο αναφοράς (ως %, εξαιρουμένων των διαχειριστικών αμοιβών και των αμοιβών απόδοσης)		
	1ος μήνας της περιόδου αναφοράς		

Τύπος δεδομένων		Αναφερόμενα δεδομένα	
2ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
...			
...			
Τελευταίος μήνας της περιόδου αναφοράς			
γ) Μεταβολή της καθαρής αξίας ενεργητικού (ΚΑΕ) του ΟΕΕ κατά την περίοδο αναφοράς (ως %, συμπεριλαμβανομένης της επίπτωσης εγγραφών και εξοφλήσεων)			
1ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
2ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
...			
...			
Τελευταίος μήνας της περιόδου αναφοράς			
δ) Εγγραφές κατά την περίοδο αναφοράς			
1ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
2ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
...			
...			
Τελευταίος μήνας της περιόδου αναφοράς			
ε) Εξοφλήσεις κατά την περίοδο αναφοράς			
1ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
2ος μήνας της περιόδου αναφοράς			
...			
...			
Τελευταίος μήνας της περιόδου αναφοράς			

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.

Αποτελέσματα ελέγχων με προσομοίωση ακραίων καταστάσεων

Παρακαλούμε αναφέρετε τα αποτελέσματα των ελέγχων με προσομοίωση ακραίων καταστάσεων που εκτελέστηκαν βάσει του στοιχείου β) του άρθρου 15 παράγραφος 3 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ [κίνδυνοι οι οποίοι συνδέονται με κάθε επενδυτική θέση του ΟΕΕ και η συνολική τους επίδραση στο χαρτοφυλάκιο του ΟΕΕ μπορούν να εντοπίζονται, να μετρώνται, να τίθενται υπό διαχείριση και να παρακολουθούνται κατάλληλα σε συνεχή βάση, μεταξύ άλλων μέσω της χρήσης κατάλληλων διαδικασιών μέτρησης κινδύνων σε ακραίες καταστάσεις (stress testing)] (ελεύθερο κείμενο)

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.

Παρακαλούμε αναφέρετε τα αποτελέσματα των ελέγχων με προσομοίωση ακραίων καταστάσεων που εκτελέστηκαν βάσει του δεύτερου εδαφίου του άρθρου 16 παράγραφος 1 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ. [Ο ΔΟΕΕ διεξάγει τακτικά μετρήσεις κινδύνων σε ακραίες καταστάσεις (stress tests), υπό κανονικές και υπό έκτακτες συνθήκες ρευστότητας που του επιτρέπουν να εκτιμά τον κίνδυνο ρευστότητας του ΟΕΕ και να παρακολουθεί τον κίνδυνο ρευστότητας του ΟΕΕ αναλόγως.] (ελεύθερο κείμενο)

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.

Πληροφορίες που διατίθενται στις αρμόδιες αρχές ειδικά για τον ΟΕΕ

(άρθρο 24 παράγραφος 4 της οδηγίας 2011/61/ΕΕ)

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
1	Από το ποσό των ασφαλειών και άλλων μορφών πιστωτικής στήριξης που έχει παράσχει ο αναφέρων ΟΕΕ σε αντισυμβαλλομένους: τι ποσοστό έχει επανυποθηκευτεί από τους αντισυμβαλλομένους;		
	Κίνδυνος δανεισμού και έκθεσης		
2	Αξία δανείων σε μετρητά ή τίτλους που αντιπροσωπεύεται από:		
	Ανασφάλιστα δάνεια σε μετρητά		
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω βασικού μεσίτη:		
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω συμφωνίας πώλησης και επαναγοράς (αγοράς και επαναπώλησης):		
	Τιτλοποιημένα/ασφαλισμένα δάνεια σε μετρητά — Μέσω άλλου:		
3	Αξία δανείων ενσωματωμένων σε χρηματοοικονομικά μέσα		
	Παράγωγα που τελούν υπό διαπραγμάτευση σε χρηματιστήριο: Ακαθάριστη έκθεση μείον το παρεχόμενο περιθώριο ασφαλείας		

	Τύπος δεδομένων	Αναφερόμενα δεδομένα	
	Εξωχρηματιστηριακά παράγωγα: Ακαθάριστη έκθεση μείον το παρεχόμενο περιθώριο ασφαλείας		
4	Πέντε μεγαλύτερες πηγές δανεισμού σε μετρητά ή τίτλους (αρνητικές θέσεις):		
	Η μεγαλύτερη:		
	Η 2η μεγαλύτερη:		
	Η 3η μεγαλύτερη:		
	Η 4η μεγαλύτερη:		
	Η 5η μεγαλύτερη:		
5	Αξία τίτλων που ελήφθησαν ως δάνειο για αρνητικές θέσεις		
6	Ακαθάριστη έκθεση χρηματοοικονομικών και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομικών δομών που ελέγχονται από τον ΟΕΕ, όπως ορίζεται στην αιτιολογική σκέψη 78 της ΟΔΟΕΕ		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	Χρηματοοικονομική και, ανάλογα με την περίπτωση, ή νομική δομή		
	...		
7	Μόχλευση του ΟΕΕ:		
	α) Μέθοδος βάσει των ακαθάριστων αξιών		
	β) Μέθοδος βάσει των δεσμεύσεων		

Οι χρηματικές αξίες θα πρέπει να αναφέρονται στο βασικό νόμισμα του ΟΕΕ.