

1
OPATRENIE
Národnej banky Slovenska
zo 17. februára 2015

**o predkladaní informácií správcami alternatívnych investičných fondov
na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika**

Národná banka Slovenska podľa § 191 ods. 1 zákona č. 203/2011 Z. z. o kolektívnom investovaní a § 192a ods. 2 zákona č. 203/2011 Z. z. o kolektívnom investovaní v znení zákona č. 206/2013 Z. z. (ďalej len „zákon“) a § 35 ods. 2 zákona č. 747/2004 Z. z. o dohľade nad finančným trhom a o zmene a doplnení niektorých zákonov v znení neskorších predpisov ustanovuje:

§ 1

- (1) Toto opatrenie sa vzťahuje na
- a) správcovskú spoločnosť, ktorá spravuje alternatívne investičné fondy a zahraničné alternatívne investičné fondy na základe povolenia podľa § 28a zákona,
 - b) samosprávny alternatívny investičný fond, ktorý vykonáva svoju správu samostatne na základe povolenia podľa § 28a zákona,
 - c) osobu, ktorá spravuje alternatívne investičné fondy na základe zápisu do registra správcov alternatívnych investičných fondov podľa § 31b zákona.

(2) Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika sa predkladajú Národnej banke Slovenska vo výkaze, ktorého konsolidovaný obsah, vrátane metodiky na vypracúvanie, je uvedený v prílohe.

(3) Ak osoba podľa odseku 1 spravuje strešný alternatívny investičný fond podľa § 6 ods. 1 zákona, ktorý sa skladá z viacerých podfondov, výkaz sa vypracúva a predkladá za každý podfond samostatne.

(4) Ak osoba podľa odseku 1 spravuje viacero zberných alternatívnych investičných fondov podľa § 3 písm. ai) zákona rovnakého hlavného alternatívneho investičného fondu podľa § 3 písm. ai) prvého bodu zákona, výkaz sa predkladá osobitne za každý zberný alternatívny investičný fond. Osoba podľa odseku 1, ktorá spravuje hlavný alternatívny investičný fond, predkladá osobitne výkaz za tento fond.

§ 2

(1) Výkaz sa vypracúva k poslednému pracovnému dňu príslušného obdobia, za ktoré sa predkladajú informácie.

(2) Informácie sa predkladajú za príslušné obdobia podľa kalendára Transeurópskeho automatizovaného systému hrubého zúčtovania expresných transferov v reálnom čase (TARGET) a končia sa každý rok v poslednom pracovnom dni v mesiacoch marec, jún, september a december. Ak je posledný pracovný deň obdobia podľa tohto

kalendára štátnym sviatkom alebo dňom pracovného pokoja a k tomuto dňu nie sú k dispozícii žiadne údaje, použijú sa informácie z predchádzajúceho pracovného dňa, avšak dátum vykazovania zostáva posledný deň v súlade s týmto kalendárom.

(3) Výkaz sa predkladá pravidelne za obdobie podľa osobitného predpisu.¹⁾

(4) Výkaz sa predkladá v lehote podľa osobitného predpisu.²⁾

(5) Výkaz sa prvýkrát predkladá za obdobie začínajúce prvým dňom nasledujúceho kalendárneho štvrt'roka, ak osoba podľa § 1 ods. 1 má k dispozícii informácie, ktoré môže vykázať až do konca prvého vykazovacieho obdobia.

§ 3

(1) Výkaz sa predkladá Národnej banke Slovenska elektronicky prostredníctvom informačného systému Register správcov alternatívnych investičných fondov (ďalej len „register správcov“).

(2) Výkaz sa predkladá v súbore vo formáte XML (.xml), ktorého opis dátového rozhrania definovaný príslušnou XSD schémou je sprístupnený v registri správcov na webovom sídle Národnej banky Slovenska.

(3) Ak osobe podľa § 1 ods. 1 technické prostriedky neumožňujú predloženie výkazu vo formáte podľa odseku 2, môže výkaz predložiť vo formáte Office Open XML (.xlsx), ktorého vzor je sprístupnený v registri správcov na webovom sídle Národnej banky Slovenska, alebo v inom formáte, ak sa na tom vopred s Národnou bankou Slovenska dohodne.

§ 4

Toto opatrenie nadobúda účinnosť 15. marca 2015.

Jozef Makúch
guvernér
v z. Ján Tóth v. r.
viceguvernér

Vydávajúci útvar: odbor regulácie
oddelenie regulácie trhu cenných papierov
a dôchodkového sporenia

tel.: +421 2 5787 3301
fax.: +421 2 5787 1118

¹⁾ Čl. 110 ods. 3 až 5 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) č. 231/2013 z 19. decembra 2012, ktorým sa dopĺňa smernica Európskeho parlamentu a Rady 2011/61/EÚ, pokiaľ ide o výnimky, všeobecné podmienky výkonu činnosti, depozitárov, pákový efekt, transparentnosť a dohľad (Ú. v. EÚ L 83, 22.3.2013).

²⁾ Čl. 110 ods. 1 delegovaného nariadenia (EÚ) č. 231/2013.

Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika

Informácie, ktoré sa poskytujú za správcu AIF podľa § 189a ods. 1 a § 192a ods. 1 zákona					
(čl. 3 ods. 3 písm. d) a čl. 24 ods. 1 AIFMD)					
Typ údajov		Vykazované údaje			
Správca AIF - Hlavička súboru					
1	Vykazujúci členský štát				
2	Verzia				
3	Dátum a čas vytvorenia súboru				
Správca AIF - Hlavička výkazu					
4	Typ výkazu				
5	Obsah vykazovaných údajov				
6	Začiatok vykazovaného obdobia				
7	Koniec vykazovaného obdobia				
8	Typ vykazovaného obdobia				
9	Rok, za ktorý sa údaje vykazujú				
10	Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov				
11	Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov				
12	Zmena štvrtroku, počas ktorého dochádza k zmene frekvencie a/alebo obsahu povinne vykazovaných údajov				
13	Posledný výkaz				
Správca AIF - Popis predpokladu					
		14	15		
		Číslo položky	Popis predpokladu		
	Položka číslo				
	Položka číslo				
	Položka číslo				
	...				
16	Kód správcu AIF, ktorý vykazuje				
17	Jurisdikcia správcu AIF				
18	Vnútroštátny identifikačný kód správcu AIF				
19	Názov správcu AIF				
20	Správca AIF z EHP				
21	Informácia o nevykazovaní údajov za správcu AIF				
Správca AIF - Identifikačné údaje					
22	LEI kód správcu AIF				
23	BIC kód správcu AIF				
24	Vnútroštátny identifikátor predchodcu správcu AIF - vykazujúci členský štát				
25	Vnútroštátny identifikátor predchodcu správcu AIF - vnútroštátny identifikačný kód				
Päť hlavných trhov, na ktorých správca AIF obchoduje v mene AIF, ktoré spravuje					
		26	27	28	29
		Poradie	Kód pre typ trhu	Kód trhu	Celková hodnota trhu
	Prvý najdôležitejší trh	1			
	Druhý najdôležitejší trh	2			
	Tretí najdôležitejší trh	3			
	Štvrtý najdôležitejší trh	4			
	Piaty najdôležitejší trh	5			
Päť hlavných nástrojov, s ktorými správca AIF obchoduje v mene AIF, ktoré spravuje					
		30	31	32	
		Poradie	Kód podtypu aktiva	Celková hodnota podtypu aktiva	
	Prvý najdôležitejší nástroj	1			
	Druhý najdôležitejší nástroj	2			
	Tretí najdôležitejší nástroj	3			
	Štvrtý najdôležitejší nástroj	4			
	Piaty najdôležitejší nástroj	5			
Hodnota spravovaných aktív všetkých spravovaných AIF vypočítaná podľa čl. 2 delegovaného nariadenia (EÚ) č. 231/2013					
33	Celková hodnota spravovaných aktív (AuM) v eurách				
34	Celková hodnota spravovaných aktív (AuM) v základnej mene (ak je rovnaká pre všetky AIF a zároveň iná ako euro)				
35	Základná mena správcu AIF (ak je rovnaká pre všetky AIF)				
36	Základná mena / EUR typ referenčného FX kurzu				
37	Základná mena / EUR FX kurz				
38	Základná mena / EUR popis referenčného FX kurzu, ktorý nie je určený ECB				

Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika

Informácie, ktoré sa poskytujú za AIF podľa § 189a ods. 1 a § 192a ods. 1 zákona (čl. 3 ods. 3 písm. d) a čl. 24 ods. 1 AIFMD)								
Typ údajov		Vykazované údaje						
AIF - Hlavička súboru								
1	Vykazujúci členský štát							
2	Verzia							
3	Dátum a čas vytvorenia súboru							
AIF - Hlavička výkazu								
4	Typ výkazu							
5	Obsah vykazovaných údajov							
6	Začiatok vykazovaného obdobia							
7	Koniec vykazovaného obdobia							
8	Typ vykazovaného obdobia							
9	Rok, za ktorý sa údaje vykazujú							
10	Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov							
11	Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov							
12	Zmena štvrťroku, počas ktorého dochádza k zmene frekvencie a/alebo obsahu povinne vykazovaných údajov							
13	Posledný výkaz							
Správca AIF - Popis predpokladu								
		14	15					
		Číslo položky	Popis predpokladu					
	Číslo položky							
	Číslo položky							
	Číslo položky							
	...							
16	Vnútroštatny identifikačný kód správcu AIF							
17	Vnútroštatny identifikačný kód AIF							
18	Názov AIF							
19	AIF z EHP							
20	Kód pre kategóriu vykazovania AIF							
21	Sídlo AIF							
22	Dátum vzniku AIF							
23	Informácia o nevykazovaní údajov za AIF							
Identifikácia AIF								
Identifikačné kódy AIF, ak sa uplatňujú								
24	LEI kód AIF							
25	ISIN kód AIF							
26	CUSIP kód AIF							
27	SEDOL kód AIF							
28	Bloomberg kód AIF							
29	Reuters kód AIF							
30	ECB kód AIF							
31	Vnútroštatny identifikátor predchodcu AIF - vykazujúci členský štát							
32	Vnútroštatny identifikátor predchodcu AIF - vnútroštatny identifikačný kód							
Identifikačné kódy triedy akcií, ak sa uplatňujú								
33	Trieda akcií AIF							
Ak je v dátovom poli 33 uvedené, že AIF má viac tried akcií, potom pre každú triedu akcií sa uvádzajú všetky príslušné identifikačné údaje, ak sa uplatňujú.								
		34	35	36	37	38	39	40
		Vnútroštatny identifikačný kód triedy akcií	ISIN kód triedy akcií	SEDOL kód triedy akcií	CUSIP kód triedy akcií	Bloomberg kód triedy akcií	Reuters kód triedy akcií	Názov triedy akcií
	Trieda akcií							
	Trieda akcií							
	Trieda akcií							
	...							
Štruktúra hlavný fond a zberný fond								
41	Postavenie AIF v štruktúre hlavný fond a zberný fond							
Ak je v dátovom poli 41 uvedený kód "FEEDER", potom pre každý zberný AIF sa uvádzajú príslušné identifikačné údaje o všetkých hlavných AIF, ak sa uplatňujú.								
		42	43	44				
		Názov hlavného AIF	Vnútroštatny identifikátor hlavného AIF - vykazujúci členský štát	Vnútroštatny identifikátor hlavného AIF - vnútroštatny identifikačný kód				
	hlavný AIF							
	hlavný AIF							
	hlavný AIF							
	...							
Identifikácia primárneho(-ych) brokera(-ov) AIF								
Pre každého primárneho brokera								
		45	46	47				
		Názov primárneho brokera	LEI kód primárneho brokera	BIC kód primárneho brokera				
	Primárny broker							
	Primárny broker							
	Primárny broker							
	...							
Informácie o základnej mene								
48	Celková hodnota spravovaných aktív AIF (AuM) v základnej mene							
49	Základná mena AIF							
50	Základná mena / EUR FX kurz							
51	Základná mena / EUR typ referenčného FX kurzu							
52	Základná mena / EUR popis referenčného FX kurzu, ktorý nie je určený ECB							
53	Celková čistá hodnota aktív AIF							
Jurisdikcie troch hlavných zdrojov financovania (okrem podielov alebo akcií AIF kúpených investormi)								
54	Krajina prvého hlavného zdroja financovania							
55	Krajina druhého hlavného zdroja financovania							
56	Krajina tretieho hlavného zdroja financovania							
Druh AIF								

57	Prevažujúci druh AIF (vyberá sa jeden) - "Hedžový Fond" - "Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií" - "Fond investujúci do nehnuteľností" - "Fond fondov" - "Iný fond" - "Žiadny"									
Rozdelenie investičných stratégií										
<i>(Uvádza sa rozdelenie investičných stratégií AIF v závislosti od prevažujúceho druhu AIF zvoleného v dátovom poli 57. Bližšie informácie ako vyplníš toto dátové pole sa nachádzajú v usmernení ESMA)</i>										
		58	59	60	61					
		Kód investičnej stratégie	Označenie, či podstratégia najlepšie opisuje stratégiu AIF	Podiel na čistej hodnote aktív v %	Popis pre druh stratégie AIF "Iný fond"					
a) Stratégie hedžového fondu										
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Hedžový fond". Uvádza sa len príslušná podstratégia.)</i>										
<i>Uvádzajú sa stratégie hedžových fondov, ktoré najlepšie opisujú stratégiu AIF.</i>										
	Akcie: tendencia v prospech dlhých pozícií (Long Bias)	EQTY_LGBS								
	Akcie: dlhé/krátke pozície (Long/Short)	EQTY_LGST								
	Akcie: trhovo neutrálne (Market Neutral)	EQTY_MTNL								
	Akcie: tendencia v prospech krátkych pozícií (Short Bias)	EQTY_STBS								
	Pomerná hodnota: arbitráž fixného príjmu (Fixed Income Arbitrage)	RELV_FXIA								
	Pomerná hodnota: arbitráž konvertibilných dlhopisov (Convertible Bond Arbitrage)	RELV_CBAR								
	Pomerná hodnota: arbitráž volatility (Volatility Arbitrage)	RELV_VLAR								
	Podľa udalostí: problémy/reštrukturalizácia (Distressed/Restructuring)	EVDR_DSRS								
	Podľa udalostí: riziková arbitráž/arbitráž zlúčenía (Risk Arbitrage/Merger Arbitrage)	EVDR_RAMA								
	Podľa udalostí: osobitné situácie s akciami (Equity Special Situations)	EVDR_EYSS								
	Kredit: dlhé/krátke pozície (Credit Long/Short)	CRED_LGST								
	Kredit: požičiavanie na základe aktív (Credit Asset Based Lending)	CRED_LGST								
	Makro (Macro)	MACR_MACR								
	Spravované futurity/poradenstvo pri obchodovaní s komoditami (Managed Futures/CTA): základné	MANF_CTAF								
	Spravované futurity/poradenstvo pri obchodovaní s komoditami (Managed Futures/CTA): kvantitatívne	MANF_CTAQ								
	Multi-stratégiový hedžový fond	MULT_HFND								
	Iná stratégia hedžového fondu	OTHR_HFND								
b) Stratégie investovania do verejne neobchodovateľných akcií										
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií". Uvádza sa len príslušná podstratégia.)</i>										
<i>Uvádzajú sa stratégie investovania do verejne neobchodovateľných akcií, ktoré najlepšie opisujú stratégiu AIF.</i>										
	Rizikový kapitál	VENT_CAPL								
	Rastový kapitál	GRTH_CAPL								
	Mezaninový kapitál	MZNE_CAPL								
	Multi-stratégiový fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií	MULT_PEQF								
	Iná stratégia fondu investujúceho do verejne neobchodovateľných akcií	OTHR_PEQF								
c) Stratégie investovania v oblasti nehnuteľností										
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Fond investujúci do nehnuteľností". Uvádza sa len príslušná podstratégia.)</i>										
<i>Uvádzajú sa stratégie investovania v oblasti nehnuteľností, ktoré najlepšie opisujú stratégiu AIF.</i>										
	Bytové nehnuteľnosti	RESL_REST								
	Obchodné nehnuteľnosti	COML_REST								
	Priemyselné nehnuteľnosti	INDL_REST								
	Multi-stratégiový fond investujúci do nehnuteľností	MULT_REST								
	Iná stratégia v oblasti nehnuteľností	OTHR_REST								
d) Stratégie fondu fondov										
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Fondy fondov". Uvádza sa len príslušná podstratégia.)</i>										
<i>Uvádzajú sa stratégie "Fondu fondov", ktoré najlepšie opisujú stratégiu AIF.</i>										
	Fond hedžových fondov	FOFS_FHFS								
	Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií	FOFS_PRIV								
	Iný fond fondov	OTHR_FOFS								
e) Iné stratégie										
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Iné fondy". Uvádza sa len príslušná podstratégia.)</i>										
<i>Uvádza sa "iná" stratégia, ktorá najlepšie opisuje stratégiu AIF.</i>										
	Komoditný fond	OTHR_COMF								
	Kapitálový fond	OTHR_EQYF								
	Fond s fixným príjmom	OTHR_FXIF								
	Infraštruktúrny fond	OTHR_INF								
	Iný fond	OTHR_OTHF								
62	Počet transakcií podľa HFT *									
63	Trhová hodnota nákupov a predajov v základnej mene podľa HFT *									
Hlavné expozície a najdôležitejšia koncentrácia										
Hlavné nástroje, s ktorými AIF obchoduje										
		64	65	66	67	68	69 to 74	75	76	77
		Poradie	Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj	Druh kódu nástroja	Názov nástroja	ISIN kód nástroja	All kód nástroja - Burzový kód - Burzový kód produktu - Derivátový typ - Put/Call identifikátor - Platnosť/Dátum dodania - Realizačná cena	Druh pozície (dlhá/krátka)	Hodnota pozície nástroja (vypočítaná podľa § 189a zákona) (čl. 3 AIFMD)	Hedžing v % pre krátku pozíciu *
	Prvý najdôležitejší nástroj	1								
	Druhý najdôležitejší nástroj	2								
	Tretí najdôležitejší nástroj	3								
	Štvrtý najdôležitejší nástroj	4								
	Piaty najdôležitejší nástroj	5								
Geografické zameranie										
<i>Uvádza sa geografické rozdelenie investícií v držbe AIF podľa percentuálneho podielu na celkovej čistej hodnote aktív AIF</i>										
		% z čistej hodnoty aktív AIF								

78	Afrika												
79	Ázia a Tichý oceán (okrem Blízkeho východu)												
80	Európa (okrem EHP)												
81	Európa (EHP)												
82	Blízky východ												
83	Severná Amerika												
84	Južná Amerika												
85	Nadnárodný / viac regiónov												
Uvádza sa geografické rozdelenie investícií v držbe AIF podľa percentuálneho podielu na celkovej hodnote spravovaných aktív *													
		% z celkovej hodnoty spravovaných aktív *											
86	Afrika *												
87	Ázia a Tichý oceán (okrem Blízkeho východu) *												
88	Európa (okrem EHP) *												
89	Európa (EHP) *												
90	Blízky východ *												
91	Severná Amerika *												
92	Južná Amerika *												
93	Nadnárodný / viac regiónov *												
Desať hlavných expozícií AIF k dátumu vypracovania výkazu (s najvyššou hodnotou z absolútneho hľadiska)													
		94	95	96	97	98	99	100	101	102			
		Poradie	Makro typ aktíva	Podtyp aktíva	Druh pozície (dlhá/krátka)	Celková hodnota	Celková hodnota v percentách	Názov protistrany	LEI kód protistrany	BIC kód protistrany			
		1											
		2											
		3											
		4											
		5											
		6											
		7											
		8											
		9											
		10											
Päť najdôležitejších koncentrácií v portfóliu													
		103	104	105	106	107	108	109	110	111	112		
		Poradie	Typ aktíva	Druh pozície (dlhá/krátka)	Kód pre typ trhu	Kód trhu	Celková hodnota	Celková hodnota v percentách	Názov protistrany	LEI kód protistrany	BIC kód protistrany		
		1											
		2											
		3											
		4											
		5											
Charakteristická veľkosť obchodu/pozície													
<i>(Toto dátové pole sa vyplňa, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií")</i>													
113	[Vyberá sa jedna veľkosť pozície] Veľmi malý Malý Menší / stredný trh Väčší / stredný trh Veľký Nešpecifikujúci												
Hlavné trhy, na ktorých AIF obchoduje													
		114	115	116	117								
		Poradie	Kód pre typ trhu	Kód trhu	Celková hodnota								
		1											
		2											
		3											
Konzentrácia investorov													
118	Uvádza sa približný percentuálny podiel vlastného kapitálu AIF, ktorý je v skutočnom vlastníctve piatich nominálnych vlastníkov, ktorí majú najväčšiu účasť na vlastnom kapitáli AIF (ako percentuálny podiel podielových listov / akcií AIF v obehu; prehľad nominálnych vlastníkov, ak sú známi alebo ak je to možné)												
119	Profesionálni klienti (podľa § 8a zákona č. 566/2001 Z. z.) (smernica 2004/39/ES (MIFID))												
120	Retailoví investori												

Peňažné hodnoty sa vykazujú v základnej mene AIF.

* Dodatočné informácie, ktoré môže Národná banka Slovenska (príslušný orgán domovského štátu) požadovať od správcu AIF, aby ich poskytoval na periodickej báze na základe § 189a ods. 5 zákona (čl. 24 ods. 5 AIFMD).

Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika

Informácie, ktoré sa poskytujú za AIF podľa § 189a ods. 2 zákona (čl. 24 ods. 2 AIFMD)				
Typ údajov	Vykazované údaje			
Obchodované nástroje a jednotlivé expozície				
Jednotlivé expozície, s ktorými AIF obchoduje a hlavné kategórie aktív, do ktorých AIF investoval ku dňu vypracovania výkazu:				
	121	122	123	124
	Kód podtypu aktíva	Hrubá hodnota	Dlhá hodnota	Krátka hodnota
a) Cenné papiere				
Hotovosť a peňažné ekvivalenty (z toho:)				
Vkladové listy	SEC_CSH_CODP			
Obchodné cenné papiere	SEC_CSH_COMP			
Ostatné vklady	SEC_CSH_OTHD			
Iná hotovosť a peňažné ekvivalenty (okrem štátnych cenných papierov)	SEC_CSH_OTHC			
Kótované akcie (z toho:)				
Vydané finančnými inštitúciami	SEC_LEQ_IFIN			
Ostatné kótované akcie	SEC_LEQ_OTHR			
Nekótované akcie	SEC_UEQ_UEQY			
Podnikové dlhopisy nevydané finančnými inštitúciami (z toho:)				
Investičný stupeň	SEC_CPN_INVG			
Neinvestičný stupeň	SEC_CPN_NIVG			
Podnikové dlhopisy vydané finančnými inštitúciami (z toho:)				
Investičný stupeň	SEC_CPI_INVG			
Neinvestičný stupeň	SEC_CPI_NIVG			
Štátne dlhopisy (z toho:)				
Dlhopisy EÚ s lehotou splatnosti do 1 roka	SEC_SBD_EUBY			
Dlhopisy EÚ s lehotou splatnosti nad 1 rok	SEC_SBD_EUBM			
Dlhopisy mimo G10 s lehotou splatnosti do 1 roka	SEC_SBD_NOGY			
Dlhopisy mimo G10 s lehotou splatnosti nad 1 rok	SEC_SBD_NOGM			
Dlhopisy G10 mimo EÚ s lehotou splatnosti do 1 roka	SEC_SBD_EUGY			
Dlhopisy G10 mimo EÚ s lehotou splatnosti nad 1 rok	SEC_SBD_EUGM			
Komunálne dlhopisy				
Komunálne dlhopisy	SEC_MBN_MNPL			
Konvertibilné dlhopisy nevydané finančnými inštitúciami (z toho:)				
Investičný stupeň	SEC_CBN_INVG			
Neinvestičný stupeň	SEC_CBN_NIVG			
Konvertibilné dlhopisy vydané finančnými inštitúciami (z toho:)				
Investičný stupeň	SEC_CBI_INVG			
Neinvestičný stupeň	SEC_CBI_NIVG			
Úvery (z toho:)				
Úvery s pákovým efektom	SEC_LON_LEVEL			
Ostatné úvery	SEC_LON_OTHL			
Štruktúrované / sekuritizované produkty (z toho:)				
Cenný papier krytý aktívami - ABS	SEC_SSP_SABS			
Cenný papier krytý hypotekárnym úverom na bytové nehnuteľnosti - RMBS	SEC_SSP_RMBS			
Cenný papier krytý hypotekárnym úverom na obchodné nehnuteľnosti - CMBS	SEC_SSP_CMBS			
Cenné papiere kryté hypotekárnym úverom emitované podnikmi sponzorovanými vládou - Agency MBS	SEC_SSP_AMBS			
Krátky cenný papier krytý aktívami - ABCP	SEC_SSP_ABCP			
Krytý dlhový / úverový záväzok - CDO/CLO	SEC_SSP_CDOC			
Štruktúrované certifikáty - Structured certificates	SEC_SSP_STRC			
Produkt obchodovaný na burze - ETP	SEC_SSP_SETP			
Iný	SEC_SSP_OTHS			
b) Deriváty				
Akciové deriváty (z toho:)				
Súvisiace s finančnými inštitúciami	DER_EQD_FINI			
Ostatné akciové deriváty	DER_EQD_OTHD			
Deriváty s fixným príjmom	DER_FID_FIXI			
Swapy na kreditné zlyhanie - CDS (z toho:)				
Jednostranný finančný CDS	DER_CDS_SNFI			
Jednostranný štátny CDS	DER_CDS_SNSO			
Jednostranný iný CDS	DER_CDS_SNOT			
Indexový CDS	DER_CDS_INDX			
Exotický (vrátane tranže na kreditné zlyhanie)	DER_CDS_EXOT			
Menové deriváty (na investičné účely)	DER_FEX_INVT			
Menové deriváty (na účely zaistenia)	DER_FEX_HEDG			
Úrokové deriváty	DER_IRD_INTR			
Komoditné deriváty (z toho:)				
Energie (z toho:)				
Ropa	DER_CTY_ECOL			
Zemný plyn	DER_CTY_ENNG			
Elektrická energia	DER_CTY_ENPW			
Iná energia	DER_CTY_ENOT			
Drahé kovy (z toho:)				
Zlato	DER_CTY_PMGD			
Iné drahé kovy	DER_CTY_PMOT			
Ostatné komodity (z toho:)				
Priemyselné kovy	DER_CTY_OTIM			
Hospodárske zvieratá	DER_CTY_OTLS			
Poľnohospodárske výrobky	DER_CTY_OTAP			
Iné ostatné komodity	DER_CTY_OTHR			
Ostatné deriváty				
Iné deriváty	DER_OTH_OTHR			
c) Fyzické (skutočné/hmotné) aktíva				
Fyzické: nehnuteľnosti (z toho:)				
Bytové nehnuteľnosti	PHY_RES_RESL			
Obchodné nehnuteľnosti	PHY_RES_COML			
Fyzické: komodity	PHY_CTY_PCTY			
Fyzické: drevo	PHY_TIM_PTIM			
Fyzické: umelecké diela a zberateľské hodnoty	PHY_ART_PART			
Fyzické: aktíva v oblasti dopravy	PHY_TPT_PTPT			
Fyzické: iné	PHY_OTH_OTHR			
d) Podniky kolektívneho investovania				
Investície do PKI spravovaných správcom AIF (z toho:)				
Fondy peňažného trhu a správa peňažných prostriedkov PKI	CIU_OAM_MMFC			
ETF	CIU_OAM_AETF			
Iné PKI	CIU_OAM_OTHR			
Investície do PKI, ktoré nie sú spravované správcom AIF (z toho:)				
Fondy peňažného trhu a správa peňažných prostriedkov PKI	CIU_NAM_MMFC			
ETF	CIU_NAM_AETF			
Iné PKI	CIU_NAM_OTHR			
e) Ostatné triedy aktív				
Ostatné spolu	OTH_OTH_OTHR			
Hodnota obratu v každej triede aktív za vykazované mesiace				

		125	126	127			
		Kód podtypu aktíva	Trhová hodnota	Nominálna hodnota			
a) Cenné papiere							
	Hotovosť a peňažné ekvivalenty	SEC_CSH_CSH					
	Kótované akcie	SEC_LEQ_LEQ					
	Nekótované akcie	SEC_UEQ_UEQ					
Podnikové dlhopisy nevydané finančnými inštitúciami (z toho:)							
	Investičný stupeň	SEC_CPN_IVG					
	Neinvestičný stupeň	SEC_CPN_NIG					
	Podnikové dlhopisy vydané finančnými inštitúciami	SEC_CPI_CPI					
Štátne dlhopisy (z toho:)							
	Dlhopisy členského štátu EÚ	SEC_SBD_EUB					
	Dlhopisy nečlenského štátu EÚ	SEC_SBD_NEU					
	Komunálne dlhopisy	SEC_MUN_MUN					
	Konvertibilné dlhopisy	SEC_CBD_CBD					
	Úvery	SEC_LON_LON					
	Štruktúrované/sekuritizované produkty	SEC_SSP_SSP					
b) Deriváty							
	Akciové deriváty	DER_EQD_EQD					
	Deriváty s fixným príjmom	DER_FID_FID					
	Swapy na kreditné zlyhanie - CDS	DER_CDS_CDS					
	Menové deriváty (na účely zaistenia)	DER_FEX_HED					
	Menové deriváty (na investičné účely)	DER_FEX_INV					
	Úrokové deriváty	DER_IRD_IRD					
	Komoditné deriváty	DER_CTY_CTY					
	Ostatné deriváty	DER_OTH_OTH					
c) Fyzické (skutočné/hmotné) aktíva							
	Fyzické: komodity	PHY_CTY_CTY					
	Fyzické: nehnuteľnosti	PHY_RES_RES					
	Fyzické: drevo	PHY_TIM_TIM					
	Fyzické: umelecké diela a zberateľské hodnoty	PHY_ART_ART					
	Fyzické: aktíva v oblasti dopravy	PHY_TPT_TPT					
	Fyzické: iné	PHY_OTH_OTH					
d) Podniky kolektívneho investovania							
	Podniky kolektívneho investovania	CIU_CIU_CIU					
e) Ostatné triedy aktív							
	Ostatné spolu	OTH_OTH_OTH					
Mena expozícií							
			128	129	130		
			Mena expozície	Hodnota menovej dlhej pozície	Hodnota menovej krátkej pozície		
	Celková dlhá a krátka hodnota expozícií (pred zaistením voči menovému riziku)						
Rozhodujúci vplyv [podľa vymedzenia v smernici 2013/34/EÚ] 1)							
<i>(Následujúce dátové polia sa vyplňajú, ak je v dátovom poli 57 uvedený ako prevažujúci druh AIF "Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií"; vyplňa sa za každú spoločnosť, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv (ak ho nemá, nevyplňa sa) podľa vymedzenia v smernici 2013/34/EÚ] 1)</i>							
		131	132	133	134	135	136
	Názov spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv	LEI kód spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv	BIC kód spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv	Typ transakcie	Popis pre "Iný" typ transakcie	% hlasovacích práv	
	Spoločnosť, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv						
	Spoločnosť, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv						
	Spoločnosť, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv						
	...						
Rizikový profil AIF							
1. Profil trhového rizika							
Miera rizík							
137	Očakávaný ročný výnos z investície/vnútorná miera návratnosti (IRR) za bežných trhových podmienok (v %)						
	vyplňa sa pre každú rizikovú mieru (Net Equity Delta, Net DV01, Net CS01, VAR *, Vega expozícia *, Net FX Delta * a Net Commodity Delta *)	138	139	140 to 142	143 to 145	302	146
		Druh miery rizika	Hodnota miery rizika	Hodnota miery rizika pre pásma: - < 5 rokov - 5-15 rokov - >15 rokov	Hodnota miery rizika pre Vega expozíciu na: - aktuálne trhové úrovne * - trhové úrovne o 10% nižšie * - trhové úrovne o 10% vyššie *	Hodnota VAR *	Druh kódu metódy pre výpočet VAR *
	Net Equity Delta	NET_EQTY_DELTA					
	Net DV01	NET_DV01					
	Net CS01	NET_CS01					
	Vega expozícia *	VEGA_EXPO *					
	VAR *	VAR *					
	Net FX Delta *	NET_FX_DELTA *					
	Net Commodity Delta *	NET_CTY_DELTA *					
2. Profil rizika protistrany							
Obchodné a zúčtovacie mechanizmy							
a) Odhad v % (v trhovej hodnote) obchodovaných cenných papierov:							
<i>(ak sa s cennými papiermi neobchodovalo, nevyplňa sa)</i>							
148	Na regulovanej burze cenných papierov						
149	OTC						
b) Odhad v % (v objemoch obchodu) obchodovaných derivátov:							
<i>(ak sa s derivátmi neobchodovalo, nevyplňa sa)</i>							
150	Na regulovanej burze cenných papierov						
151	OTC						
c) Odhad v % (v objemoch obchodu) zúčtovaných derivátových transakcií:							
<i>(ak sa s derivátmi neobchodovalo, nevyplňa sa)</i>							
152	Prostredníctvom CCP						
153	Dvojstranne						
d) Odhad v % (v trhovej hodnote) zúčtovaných repo obchodov:							
<i>(ak sa s repo neobchodovalo, nevyplňa sa)</i>							
154	Prostredníctvom CCP						
155	Dvojstranne						
156	Trojstranne						
Hodnota kolaterálu a iná kreditná podpora, ktorú AIF zložil pre všetky protistrany							
157	a) Hodnota kolaterálu zloženého vo forme hotovosti a peňažných ekvivalentov						
158	b) Hodnota kolaterálu zloženého vo forme iných cenných papierov (okrem hotovosti a peňažných ekvivalentov)						
159	c) Hodnota iného zloženého kolaterálu a kreditnej podpory (vrátane nominálnej sumy na akreditívoch a podobnej kreditnej podpory tretej strany)						

Päť najväčších expozícií voči protistranám (okrem CCP)							
a) Uvádza sa päť najväčších protistrán, voči ktorým má AIF najväčšiu čistú kreditnú expozíciu ocenenú trhovými cenami, meranú ako % čistej hodnoty aktív AIF							
	160	161	162	163	164	165	
	Poradie	Expozícia protistrany	Názov protistrany	LEI kód protistrany	BIC kód protistrany	Percentuálny podiel čistej hodnoty aktív z celkovej hodnoty expozície	
Protistrana 1	1						
Protistrana 2	2						
Protistrana 3	3						
Protistrana 4	4						
Protistrana 5	5						
b) Uvádza sa päť najväčších protistrán, ktoré majú voči AIF najväčšiu čistú kreditnú expozíciu ocenenú trhovými cenami, meranú ako % čistej hodnoty aktív AIF							
	166	167	168	169	170	171	
	Poradie	Expozícia protistrany	Názov protistrany	LEI kód protistrany	BIC kód protistrany	Percentuálny podiel čistej hodnoty aktív z celkovej hodnoty expozície	
Protistrana 1	1						
Protistrana 2	2						
Protistrana 3	3						
Protistrana 4	4						
Protistrana 5	5						
Priame zúčtovanie prostredníctvom centrálnych zúčtovacích protistrán (CCPs)							
172	a) Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?						
ak nie (to znamená, ak v dátovom poli 172 je uvedený kód "false"), nasledujúce dátové polia sa preskočia a pokračuje sa dátovým polom 178							
b) Ak je v dátovom poli 172 uvedený kód "true" (áno), uvádzajú sa tri najväčšie centrálné zúčtovacie protistrany (CCP) z hľadiska čistej kreditnej expozície							
	173	174	175	176	177		
	Poradie	Názov CCP	LEI kód CCP	BIC kód CCP	Hodnota expozície CCP		
CCP 1 (nevyplňa sa, ak sa neuplatňuje)	1						
CCP 2 (nevyplňa sa, ak sa neuplatňuje)	2						
CCP 3 (nevyplňa sa, ak sa neuplatňuje)	3						
3. Profil likvidity							
Profil likvidity portfólia							
Percentuálny podiel portfólia, ktorý možno zlikvidovať v lehote:							
178	1 deň alebo menej						
179	2 – 7 dní						
180	8 – 30 dní						
181	31 – 90 dní						
182	91 – 180 dní						
183	181 – 365 dní						
184	viac ako 365 dní						
185	Hodnota nezaťažených peňažných prostriedkov						
Profil likvidity investora							
Percentuálny podiel vlastného kapitálu investora, ktorý možno vyplatiť v lehote (ako % čistej hodnoty aktív AIF):							
186	1 deň alebo menej						
187	2 – 7 dní						
188	8 – 30 dní						
189	31 – 90 dní						
190	91 – 180 dní						
191	181 – 365 dní						
192	viac ako 365 dní						
Vyplatenie investorov							
193	a) Poskytuje AIF investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie v rámci bežného postupu?						
194	b) Aká je frekvencia vyplatení investorov? (v prípade viacerých tried akcií alebo podielových listov sa uvádzajú údaje za najväčšiu triedu akcií podľa čistej hodnoty aktív) [Vyberá sa jedna možnosť] Denná Týždenná Dvojtyždenná Mesačná Štvrťročná Polročná Ročná Iná Neuplatňuje sa						
195	c) Aká je výpovedná lehota požadovaná investormi na vyplatenie v dňoch? (v prípade viacerých tried akcií alebo podielových listov sa uvádza výpovedná lehota vážená aktívami)						
196	d) Aká je lehota, počas ktorej je pozastavené vyplácanie a predávanie cenných papierov investorom ('lock-up' period) v dňoch?(ak existuje viacero tried akcií alebo podielových listov, vykazuje sa lehota vážená aktívami) Osobitný režim a prednostné zaobchádzanie						
a) Aký percentuálny podiel čistej hodnoty aktív AIF podlieha ku dňu vypracovania výkazu týmto opatreniam:							
197	Odkladanie do bočných vreciek (v %)						
198	Obmedzenie vyplácania (v %)						
199	Pozastavenie obchodovania (v %)						
200	Iné typy opatrení						
201	Iné opatrenia na správu nelikvidných aktív (v %)						
202	b) Uvádza sa percentuálny podiel čistej hodnoty aktív AIF, ktorý v súčasnosti podlieha osobitnému režimu vyplývajúmu z ich nelikvidnej povahy podľa § 159a ods. 4 zákona (čl. 23 ods. 4 písm. a) AIFMD) vrátane tých, ktoré sú uvedené v dátových poliach 197 až 201						
203	c) Existujú investori, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie alebo právo na prednostné zaobchádzanie (napríklad prostredníctvom sprievodného listu), a preto je potrebné o nich informovať investorov AIF v súlade s § 159a ods. 1 písm. j) zákona (čl. 23 ods. 1 písm. j) AIFMD)?						
d) Ak je v písmene c) (dátové pole 203) uvedený kód "true" (áno), v nasledovných dátových poliach sa uvádzajú všetky príslušné prípady prednostného zaobchádzania:							
204	Týkajúce sa odlišného poskytovania informácií / podávania správ investorom						
205	Týkajúce sa odlišných podmienok likvidity investorov						
206	Týkajúce sa odlišných podmienok poplatkov pre investorov						
207	Iné prednostné zaobchádzanie, ako sa uvádza vyššie						
Rozdelenie vlastníctva podielových listov v AIF podľa skupiny investorov							
ako % čistej hodnoty aktív na aktívach AIF; prehľad nominálnych vlastníkov, ak sú známi alebo ak je to možné							
Pre každý typ skupiny investorov:							
	208	209					
	Typ skupiny investorov	Podiel skupiny investorov na čistej hodnote aktív					
	Nefinančné korporácie (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	NFCO					
	Banky (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	BANK					
	Iné podniky kolektívneho investovania (napríklad fondy fondov, hlavné fondy) (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	OCIU					
	Iné finančné inštitúcie (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	OFIN					
	Poisťovacie korporácie (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	INSC					
	Penzijné fondy (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	PFND					
	Vláda (ak sa nevyskytuje, nevyplňa sa)	GENG					
	Domácnosti (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	HHLI					
	Neznámi (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	UNKN					
	Žiadni (ak sa nevyskytujú, nevyplňa sa)	NONE					
Likvidita financovania							

210	a) Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF (vrátane všetkých čerpaných a nečerpaných, viazaných a neviazaných úverových línií, ako aj akéhokoľvek termínovaného financovania)	
b) Rozdelenie sumy uvedenej v písmene a) medzi ďalej uvedené obdobia v závislosti od najdlhšieho obdobia, počas ktorého je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie:		
211	1 deň alebo menej	
212	2 – 7 dní	
213	8 – 30 dní	
214	31 – 90 dní	
215	91 – 180 dní	
216	181 – 365 dní	
217	viac ako 365 dní	
4. Operačné riziká a ostatné rizikové aspekty		
218	Celkový počet otvorených pozícií	
Historický rizikový profil		
a) Hrubé výnosy z investícií alebo IRR AIF za vykazované obdobie (v %, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť)		
219	Január	
220	Február	
221	Marec	
222	Apríl	
223	Máj	
224	Jún	
225	Júl	
226	August	
227	September	
228	Október	
229	November	
230	December	
b) Čisté výnosy z investícií alebo IRR AIF za vykazované obdobie (v %, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť)		
231	Január	
232	Február	
233	Marec	
234	Apríl	
235	Máj	
236	Jún	
237	Júl	
238	August	
239	September	
240	Október	
241	November	
242	December	
c) Zmena čistej hodnoty aktív AIF za vykazované obdobie (v %, vrátane vplyvu upísaní a vyplatení)		
243	Január	
244	Február	
245	Marec	
246	Apríl	
247	Máj	
248	Jún	
249	Júl	
250	August	
251	September	
252	Október	
253	November	
254	December	
d) Upísania za vykazované obdobie		
255	Január	
256	Február	
257	Marec	
258	Apríl	
259	Máj	
260	Jún	
261	Júl	
262	August	
263	September	
264	Október	
265	November	
266	December	
e) Vyplatenia za vykazované obdobie		
267	Január	
268	Február	
269	Marec	
270	Apríl	
271	Máj	
272	Jún	
273	Júl	
274	August	
275	September	
276	Október	
277	November	
278	December	
Výsledky stresových testov		
279	Uvádzajú sa výsledky stresových testov vykonaných podľa § 37a ods. 4 písm. b) zákona (čl. 15 ods. 3 písm. b) AIFMD) (riziká spojené s každou investičnou pozíciou AIF a ich celkový vplyv na portfólio AIF možno riadne identifikovať, merať, riadiť a príbežne monitorovať aj prostredníctvom použitia primeraných postupov stresového testovania;] (voľný text)	
280	Uvádzajú sa výsledky stresových testov vykonaných podľa § 37b ods. 2 zákona (čl. 16 ods. 1 druhý pododsek AIFMD) (správcovia AIF pravidelne vykonávajú stresové testy za bežných a výnimočných podmienok likvidity, ktoré im umožňujú vyhodnotiť riziko likvidity AIF a zodpovedajúcim spôsobom monitorovať riziko likvidity AIF.) (voľný text)	
Informácie, ktoré sa poskytujú za AIF podľa § 189a ods. 2 zákona - vykazujú sa vtedy, ak neboli už vykázané podľa § 189a ods. 4 zákona (čl. 24 ods. 2 AIFMD informácie, ktoré sa vykazujú vtedy, ak neboli už vykázané podľa čl. 24 ods. 4 AIFMD)		
281	Opakovaná účelová viazanosť	
282	Zo sumy kolaterálu a inej kreditnej podpory, ktorú vykazujúci AIF zložil pre protistrany: aký percentuálny podiel bol znovu účelovo viazaný protistrami?	
Riziko požičiavania si a riziko expozície		
Hodnota prijatých hotovostných pôžičiek alebo prijatých pôžičiek cenných papierov, ktoré predstavujú:		
283	Nezaistené prijaté hotovostné pôžičky	
284	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - prostredníctvom primárneho brokera	
285	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - prostredníctvom (reverznej) repo transakcie	
286	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - inak	
Hodnota prijatej pôžičky vloženéj do finančných nástrojov		

287	Deriváty obchodované na burze: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža				
288	OTC deriváty: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža				
289	Hodnota cenných papierov v rámci prijatej pôžičky na krátke pozície				
Hrubá expozícia finančných a/alebo právnych štruktúr kontrolovaných AIF podľa vymedzenia v recitáli 78 AIFMD					
		290	291	292	293
		Názov kontrolovanej štruktúry	LEI kód kontrolovanej štruktúry	BIC kód kontrolovanej štruktúry	Hodnota expozície kontrolovanej štruktúry
	Finančná a/alebo právna štruktúra				
	Finančná a/alebo právna štruktúra				
	Finančná a/alebo právna štruktúra				
				
Pákový efekt AIF					
294	a) vypočítaný podľa Hrubej metódy				
295	b) vypočítaný podľa Závazkovej metódy				

Peňažné hodnoty sa vykazujú v základnej mene AIF.

* Dodatočné informácie, ktoré môže Národná banka Slovenska (príslušný orgán domovského členského štátu) požadovať od správcu AIF, aby ich poskytoval na periodickej báze na základe § 189a ods. 5 zákona (čl. 24 ods. 5 AIFMD).

1) Údaj sa vyказuje podľa zákona č. 431/2002 Z. z. o účtovníctve v znení neskorších predpisov.

Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika

Informácie, ktoré sa poskytujú za AIF podľa § 189a ods. 4 zákona (čl. 24 ods. 4 AIFMD)						
Typ údajov	Vykazované údaje					
281	Opakovaná účelová viazanosť					
282	Zo sumy kolaterálu a inej kreditnej podpory, ktorú vykazujúci AIF zložil pre protistrany: aký percentuálny podiel bol znovu účelovo viazaný protistranami?					
Riziko požičavania si a riziko expozície						
Hodnota prijatých hotovostných pôžičiek alebo prijatých pôžičiek cenných papierov, ktoré predstavujú:						
283	Nezaistené prijaté hotovostné pôžičky					
284	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - prostredníctvom primárneho brokera					
285	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - prostredníctvom (reverznej) repo transakcie					
286	Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom / zaistené prijaté hotovostné pôžičky - inak					
Hodnota prijatej pôžičky vlozenej do finančných nástrojov						
287	Deriváty obchodované na burze: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža					
288	OTC deriváty: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža					
289	Hodnota cenných papierov v rámci prijatej pôžičky na krátke pozície					
Hrubá expozícia finančných a/alebo právnych štruktúr kontrolovaných AIF podľa vymedzenia v recitáli 78 AIFMD						
	290	291	292	293		
	Názov kontrolovanej štruktúry	LEI kód kontrolovanej štruktúry	BIC kód kontrolovanej štruktúry	Hodnota expozície kontrolovanej štruktúry		
	Finančná a/alebo právna štruktúra					
	Finančná a/alebo právna štruktúra					
	Finančná a/alebo právna štruktúra					
					
Pákový efekt AIF						
294	a) vypočítaný podľa Hrubej metódy					
295	b) vypočítaný podľa Závazkovej metódy					
Päť najväčších zdrojov požičanej si hotovosti alebo cenných papierov (krátke pozície):						
	296	297	298	299	300	301
	Poradie	Zdroj výpožičky	Názov zdroja	LEI kód zdroja	BIC kód zdroja	Suma prijatá v súvislosti s pákovým efektom
	1					
	2					
	3					
	4					
	5					

Peňažné hodnoty sa vykazujú v základnej mene AIF.

**Metodika na vypracúvanie výkazu
Informácie na účely dohľadu a monitorovanie systémového rizika**

A. Informácie, ktoré sa poskytujú za správcu AIF

1. V dátovom poli 1 „**Vykazujúci členský štát**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vyplňa sa kód členského štátu Európskej únie (ďalej len „členský štát“), v ktorom správca AIF vykazuje požadované údaje príslušnému orgánu. Povinný údaj.
2. V dátovom poli 2 „**Verzia**“ sa uvádza verzia XML Schema Definition (XSD), ktorá bola použitá pre vytvorenie súboru. Povinný údaj.
3. V dátovom poli 3 „**Dátum a čas vytvorenia súboru**“ sa uvádza dátum a čas, kedy bol súbor vytvorený. Údaj sa vyplňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-ddThh:mm:ss. Vo výkaze sa uvádza ako Koordinovaný svetový čas (Coordinated Universal Time - UTC). Povinný údaj.
4. V dátovom poli 4 „**Typ výkazu**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - a) „AMND“ (amendment) pre doplnenie už predtým vytvoreného a zaslaného výkazu alebo
 - b) „INIT“ (initial) pre vytvorenie prvého výkazu za príslušné vykazovacie obdobie. Povinný údaj.
5. V dátovom poli 5 „**Obsah vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - a) „1“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1 zákona (čl. 24 ods. 1 AIFMD) pre všetky spravované AIF,
 - b) „2“ pre údaje vykazované v súlade s § 192a ods. 1 zákona (čl. 3 ods. 3 písm. d) AIFMD) pre všetky spravované AIF alebo
 - c) „3“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1 zákona (čl. 24 ods. 1 AIFMD) pre všetky AIF, ktoré sa uvádzajú na trh v členskom štáte. Povinný údaj.
6. V dátovom poli 6 „**Začiatok vykazovaného obdobia**“ sa uvádza prvý kalendárny deň mesiaca január, apríl, júl alebo október. Údaj sa vyplňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-dd. Povinný údaj.
7. V dátovom poli 7 „**Koniec vykazovaného obdobia**“ sa uvádza posledný kalendárny deň mesiaca marec, jún, september alebo december alebo posledný deň vykonávania činnosti správcu AIF. Údaj sa vyplňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-dd. Povinný údaj.
8. V dátovom poli 8 „**Typ vykazovaného obdobia**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - A. ak frekvencia vykazovania je štvrťročná
 - a) „Q1“ pre prvý štvrťrok kalendárneho roka,
 - b) „Q2“ pre druhý štvrťrok kalendárneho roka,
 - c) „Q3“ pre tretí štvrťrok kalendárneho roka,
 - d) „Q4“ pre štvrtý štvrťrok kalendárneho roka,

B. ak frekvencia vykazovania je polročná

a) „H1“ pre prvý kalendárny polrok,

b) „H2“ pre druhý kalendárny polrok,

C. ak frekvencia vykazovania je ročná

„Y1“ pre kalendárny rok,

D. ak sa špecificky vykazuje za obdobie prvý až tretí štvrťrok, na základe zmeny pre povinné vykazovanie údajov

„X1“ pre prvý až tretí štvrťrok,

E. ak sa špecificky vykazuje za obdobie druhý až štvrtý štvrťrok, na základe zmeny pre povinné vykazovanie údajov

„X2“ pre druhý až štvrtý štvrťrok.

V rámci jedného kalendárneho roka sa nesmú jednotlivé vykazované obdobia prekrývať. Prípustné sú len nasledovné spôsoby vykazovania

a) Q1, Q2, Q3, Q4,

b) Q1, Q2, H2,

c) Q1, X2,

d) H1, H2,

e) H1, Q3, Q4,

f) Y1,

g) X1, Q4.

Povinný údaj.

9. V dátovom poli 9 „**Rok, za ktorý sa údaje vykazujú**“ sa uvádza rok, za ktorý sa údaje vykazujú. Vypĺňa sa v tvare napríklad 2013, 2014 a podobne. Povinný údaj.

10. V dátovom poli 10 „**Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľkách č. 8 a 10 prílohy č. II usmernenia ESMA. Kód informuje o zmene frekvencie vykazovania povinných údajov. Nepovinný údaj.

11. V dátovom poli 11 „**Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 8 prílohy č. II usmernenia ESMA. Kód informuje o zmene obsahu vykazovaných údajov. Nepovinný údaj.

12. V dátovom poli 12 „**Zmena štvrťroku, počas ktorého dochádza k zmene frekvencie a/alebo obsahu povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľkách č. 8 a 10 prílohy č. II usmernenia ESMA. Prípustné kódy pre príslušný štvrťrok sú nasledovné

a) „Q1“ pre prvý štvrťrok kalendárneho roka,

b) „Q2“ pre druhý štvrťrok kalendárneho roka,

c) „Q3“ pre tretí štvrťrok kalendárneho roka,

d) „Q4“ pre štvrtý štvrťrok kalendárneho roka.

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 10 "Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov“ alebo 11 „Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov“ uvedie príslušný kód. V ostatných prípadoch sa nevyplní.

13. V dátovom poli 13 „**Posledný výkaz**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či ide o konečný výkaz alebo nie. Vyplňa sa kód podľa číselníka
- „true“ (áno) pre posledný výkaz,
 - „false“ (nie) pre ostatné prípady.
- Povinný údaj.
14. V dátovom poli 14 „**Číslo položky**“ sa uvádza číslo položky, pre ktorú sa poskytuje popis predpokladu. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 15 „Popis predpokladu“ uvedie informácia. V ostatných prípadoch sa nevyplňa.
15. V dátovom poli 15 „**Popis predpokladu**“ sa uvádza voľný text týkajúci sa popisu predpokladu. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 14 „Číslo položky“ uvedie údaj. V ostatných prípadoch sa nevyplňa.
16. V dátovom poli 16 „**Kód správcu AIF, ktorý vykazuje**“ sa uvádza kód podľa číselníka
- „1“ pre správcu AIF, ktorý bol registrovaný v súlade s § 31b zákona (čl. 3 AIFMD),
 - „2“ pre správcu AIF, ktorému bolo udelené povolenie (opt-in) v súlade s § 28a zákona (čl. 7 AIFMD),
 - „3“ pre správcu AIF, ktorému bolo udelené povolenie na spravovanie AIF, u ktorých nevyužíva pákový efekt pri ich správe, investuje do nekótovaných spoločností a emitentov s cieľom získať kontrolu, v súlade s § 28a zákona (čl. 7 AIFMD),
 - „4“ pre správcu AIF, ktorému bolo udelené povolenie v súlade s § 28a zákona (čl. 7 AIFMD) a má vykazovaciu povinnosť raz za polrok,
 - „5“ pre správcu AIF, ktorému bolo udelené povolenie v súlade s § 28a zákona (čl. 7 AIFMD) a má vykazovaciu povinnosť raz za štvrtrok,
 - „6“ pre správcu AIF zo štátu mimo EÚ s režimom pre privátnu ponuku v súlade s § 150h zákona (čl. 42 AIFMD), ktorý má vykazovaciu povinnosť raz za rok,
 - „7“ pre správcu AIF zo štátu mimo EÚ s režimom pre privátnu ponuku AIF, u ktorých nevyužíva pákový efekt, investuje do nekótovaných spoločností a emitentov s cieľom získať kontrolu, v súlade s § 150h zákona (čl. 42 AIFMD),
 - „8“ pre správcu AIF zo štátu mimo EÚ s režimom pre privátnu ponuku v súlade s § 150h zákona (čl. 42 AIFMD), ktorý má vykazovaciu povinnosť raz za polrok,
 - „9“ pre správcu AIF zo štátu mimo EÚ s režimom pre privátnu ponuku v súlade s § 150h zákona (čl. 42 AIFMD), ktorý má vykazovaciu povinnosť raz za štvrtrok.
- Vyplňa sa kód zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 8 prílohy č. II usmernenia ESMA. Povinný údaj.
17. V dátovom poli 17 „**Jurisdikcia správcu AIF**“ sa uvádza právny poriadok štátu, v ktorom je správca AIF usadený. Vyplňa sa kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Povinný údaj.

18. V dátovom poli 18 „**Vnútroštátny identifikačný kód správcu AIF**“ sa uvádza unikátny identifikačný kód pridelený správcovi AIF. Vypĺňa sa kód, ktorý používajú vnútroštátne príslušné orgány v domovskom členskom štáte alebo vnútroštátne príslušné orgány referenčného členského štátu alebo vnútroštátne príslušné orgány členského štátu, kde správca AIF uvádza na trh AIF, ktoré spravuje podľa § 150h zákona (čl. 42 AIFMD). Povinný údaj.
19. V dátovom poli 19 „**Názov správcu AIF**“ sa uvádza obchodné meno správcu AIF v úplnom znení zodpovedajúce pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Povinný údaj.
20. V dátovom poli 20 „**Správca AIF z EHP**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či správca AIF má sídlo v rámci Európskeho hospodárskeho priestoru (EHP) alebo nie. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno) pre správcu AIF, ktorý má sídlo v EHP,
 - b) „false“ (nie) pre správcu AIF, ktorý má sídlo mimo EHP.
- Povinný údaj.
21. V dátovom poli 21 „**Informácia o nevykazovaní údajov za správcu AIF**“ sa uvádza informácia o tom, že správca AIF nemá k dispozícii žiadne informácie, ktoré je možné vykázat' za spravovaný AIF, ak napríklad existuje časový rozdiel medzi udelením povolenia alebo registráciou nového správcu AIF a začatím vykonávania činnosti alebo medzi vytvorením AIF a prvou investíciou. V takom prípade sa vypĺňa len časť výkazu s názvom „Správca AIF – hlavička výkazu“. V dátovom poli sa vypĺňa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno), ak nie je možné vykázat' žiadne informácie za vykazované obdobie,
 - b) „false“ (nie) v ostatných prípadoch.
- Povinný údaj.
22. V dátovom poli 22 „**LEI kód správcu AIF**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. Nepovinný údaj.
23. V dátovom poli 23 „**BIC kód správcu AIF**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nepovinný údaj.
24. V dátovom poli 24 „**Vnútroštátny identifikátor predchodcu správcu AIF – vykazujúci členský štát**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa kód predchádzajúceho členského štátu, ak došlo k zmene (údaj sa vypĺňa v prvom výkaze nasledujúcom po zmene vnútroštátneho identifikátora a v každom ďalšom výkaze). Nepovinný údaj.
25. V dátovom poli 25 „**Vnútroštátny identifikátor predchodcu správcu AIF – vnútroštátny identifikačný kód**“ sa uvádza identifikačný kód predchodcu správcu AIF, ak došlo k zmene (údaj sa vypĺňa v prvom výkaze nasledujúcom po zmene vnútroštátneho identifikátora a v každom ďalšom výkaze). Vypĺňa sa povinne len, ak

sa v dátovom poli 24 „Vnútroštátny identifikátor predchodcu správcu AIF – vykazujúci členský štát“ uvedie príslušný kód.

26. V dátovom poli 26 „**Poradie**“ sa uvádza poradie piatich najdôležitejších trhov, na ktorých správca AIF obchoduje v mene AIF, ktoré spravuje. Poradie je založené na celkovej hodnote nástrojov, ktoré tvoria každý trh. Nástroje sa zoskupujú podľa trhu, na ktorom sa obchodovanie uskutočnilo. Vypĺňa sa kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvý hlavný trh,
- b) „2“ pre druhý hlavný trh,
- c) „3“ pre tretí hlavný trh,
- d) „4“ pre štvrtý hlavný trh,
- e) „5“ pre piaty hlavný trh.

Povinný údaj.

27. V dátovom poli 27 „**Kód pre typ trhu**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „MIC“ pre trhy s MIC kódmi,
- b) „OTC“ pre mimoburzové transakcie (uvádza sa, ak správca AIF investuje prostredníctvom mimoburzových transakcií do nástroja, ktorý je tiež kótovaný na trhu),
- c) „XXX“ pre nástroje, ktoré nie sú obchodované na konkrétnom trhu (medzi tieto nástroje patria napríklad subjekty kolektívneho investovania),
- d) „NOT“ ak neexistuje žiadny trh pre vykázanie poradia (uvádza sa, ak správca AIF obchoduje na menšom počte trhov ako päť a v dátových poliach 28 „Kód trhu“ a 29 „Celková hodnota trhu“ nie sú vyplnené žiadne údaje).

Povinný údaj.

28. V dátovom poli 28 „**Kód trhu**“ sa uvádza MIC kód podľa medzinárodnej normy ISO 10383 pre príslušné obchodné miesto, na ktorom správca AIF obchoduje. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 27 „Kód pre typ trhu“ uvedie kód „MIC“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

29. V dátovom poli 29 „**Celková hodnota trhu**“ sa uvádza celková hodnota nástrojov agregovaných na úrovni piatich najdôležitejších trhov, na ktorých správca AIF obchoduje v mene spravovaných AIF, v eurách, bez desatinných miest. Hodnota nástrojov sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 27 „Kód pre typ trhu“ uvedie iný kód ako „NOT“.

30. V dátovom poli 30 „**Poradie**“ sa uvádza poradie pre päť hlavných kategórií podtypov aktív, s ktorými správca AIF obchoduje v mene spravovaných AIF. Poradie je založené na celkovej hodnote nástrojov, ktoré tvoria každú kategóriu podtypu aktíva. Nástroje sa zoskupujú podľa kategórií podtypov aktív uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA. Vypĺňa sa kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvý hlavný podtyp aktíva,
- b) „2“ pre druhý hlavný podtyp aktíva,
- c) „3“ pre tretí hlavný podtyp aktíva,

- d) „4“ pre štvrtý hlavný podtyp aktíva,
 - e) „5“ pre piaty hlavný podtyp aktíva.
- Povinný údaj.

31. V dátovom poli 31 „**Kód podtypu aktíva**“ sa uvádzajú kódy pre päť hlavných kategórií podtypov aktív, s ktorými správca AIF obchoduje v mene spravovaných AIF. Vypĺňa sa kód zo zoznamu kódov, ktorý sa nachádza v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (najvyššia úroveň dostupných detailov). Ak správca AIF obchoduje s menej ako piatimi rôznymi podtypmi aktív, vypĺňa sa kód „NTA_NTA_NOTA“ (not applicable – nie je prístupný) pre každé chýbajúce poradie. Povinný údaj.
32. V dátovom poli 32 „**Celková hodnota podtypu aktíva**“ sa uvádza celková hodnota nástrojov vypočítaná podľa čl. 2 delegovaného nariadenia Komisie (EÚ) č. 231/2013 z 19. decembra 2012, ktorým sa dopĺňa smernica Európskeho parlamentu a Rady 2011/61/EÚ, pokiaľ ide o výnimky, všeobecné podmienky výkonu činnosti, depozitárov, pákový efekt, transparentnosť a dohľad (Ú. v. EÚ L 83, 22.3.2013) (ďalej len „delegované nariadenie (EÚ) č. 231/2013“), ktorá je agregovaná na úrovni podtypu aktíva a vyjadrená v eurách, bez desatinných miest. Hodnota nástrojov sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Údaj sa vypĺňa povinne len pre podtyp aktíva, ktoré má v dátovom poli 31 „Kód podtypu aktíva“ uvedený iný kód ako „NTA_NTA_NOTA“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
33. V dátovom poli 33 „**Celková hodnota spravovaných aktív (AuM) v eurách**“ sa uvádza celková hodnota spravovaných aktív všetkých AIF vypočítaná podľa metódy uvedenej v čl. 2 a 10 delegovaného nariadenia (EÚ) č. 231/2013. Vypĺňa sa hodnota vyjadrená v eurách, bez desatinných miest. Povinný údaj.
34. V dátovom poli 34 „**Celková hodnota spravovaných aktív (AuM) v základnej mene**“ sa uvádza celková hodnota spravovaných aktív všetkých AIF vypočítaná podľa metódy uvedenej v čl. 2 a 10 delegovaného nariadenia (EÚ) č. 231/2013. Vypĺňa sa hodnota vyjadrená v základnej mene (ak všetky AIF, ktoré spravuje príslušný správca AIF sú denominované v jednej rovnakej mene, inej ako mena euro), bez desatinných miest. Hodnota sa rovná hodnote vyjadrenej v eurách vypočítanej podľa výmenného kurzu v dátovom poli 37 „Základná mena/EUR FX kurz“. Povinný údaj.
35. V dátovom poli 35 „**Základná mena správcu AIF**“ sa uvádza kód základnej meny, a to trojznakový, podľa medzinárodnej normy ISO 4217 pre všetky AIF spravované správcom AIF. Povinný údaj.
36. V dátovom poli 36 „**Základná mena/EUR typ referenčného FX kurzu**“ sa uvádza kód podľa číselníka
- a) „ECB“, ak základná mena je jednou z mien, pre ktorú výmenný kurz je eurový referenčný kurz zverejnený Európskou centrálnou bankou,
 - b) „OTH“ pre ostatné prípady.

Vypĺňa sa povinne len, ak základná mena správcu AIF uvedená v dátovom poli 35, je iná ako mena euro. Referenčný kurz ECB je zverejňovaný denne, keď je otvorený TARGET systém. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

37. V dátovom poli 37 „**Základná mena/EUR FX kurz**“ sa uvádza výmenný kurz určený Európskou centrálnou bankou a použitý pre konverziu celkovej hodnoty spravovaných aktív vyjadrenej v základnej mene za celkovú hodnotu spravovaných aktív vyjadrenú v eurách ku dňu vykazovania. Vypĺňa sa s presnosťou na štyri desatinné miesta. Vypĺňa sa povinne len, ak základná mena správcu, uvedená v dátovom poli 35, je iná ako mena euro. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
38. V dátovom poli 38 „**Základná mena/EUR popis referenčného FX kurzu, ktorý nie je určený ECB**“ sa uvádza názov zdroja eurového referenčného kurzu použitého v dátovom poli 36 „Základná mena/EUR typ referenčného FX kurzu“. Ak sa v dátovom poli 36 uvedie kód „OTH“ (to znamená, ak príslušný eurový referenčný kurz nie je zverejňovaný Európskou centrálnou bankou) vypĺňa sa voľný text. Ak sa v dátovom poli 36 uvedie kód „ECB“ (to znamená, ak sa príslušný eurový referenčný kurz zverejňuje Európskou centrálnou bankou), pole sa nevypĺňa. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 36 „Základná mena/EUR typ referenčného FX kurzu“ uvedie kód „OTH“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

B. Informácie, ktoré sa poskytujú za AIF

1. V dátovom poli 1 „**Vykazujúci členský štát**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa kód členského štátu, v ktorom správca AIF vykazuje požadované údaje príslušnému orgánu. Povinný údaj.
2. V dátovom poli 2 „**Verzia**“ sa uvádza verzia XML Schema Definition (XSD), ktorá bola použitá pre vytvorenie súboru. Povinný údaj.
3. V dátovom poli 3 „**Dátum a čas vytvorenia súboru**“ sa uvádza dátum a čas, kedy bol súbor vytvorený. Údaj sa vypĺňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-ddThh:mm:ss. Vo výkaze sa uvádza ako Koordinovaný svetový čas (Coordinated Universal Time - UTC). Povinný údaj.
4. V dátovom poli 4 „**Typ výkazu**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - a) „AMND“ (amendment) pre doplnenie už predtým vytvoreného a zaslaného výkazu alebo
 - b) „INIT“ (initial) pre vytvorenie prvého výkazu za príslušné vykazovacie obdobie. Povinný údaj.
5. V dátovom poli 5 „**Obsah vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - a) „1“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1 zákona (čl. 24 ods. 1 AIFMD),
 - b) „2“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1 a 2 zákona (čl. 24 ods. 1 a 2 AIFMD),
 - c) „3“ pre údaje vykazované v súlade s § 192a ods. 1 zákona (čl. 3 ods. 3 písm. d) AIFMD),

- d) „4“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1, 2 a 4 zákona (čl. 24 ods. 1, 2 a 4 AIFMD),
- e) „5“ pre údaje vykazované v súlade s § 189a ods. 1 a 4 zákona (čl. 24 ods. 1 a 4 AIFMD).

Povinný údaj.

- 6. V dátovom poli 6 „**Začiatok vykazovaného obdobia**“ sa uvádza prvý kalendárny deň mesiaca január, apríl, júl alebo október. Údaj sa vyplňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-dd. Povinný údaj.
- 7. V dátovom poli 7 „**Koniec vykazovaného obdobia**“ sa uvádza posledný kalendárny deň mesiaca marec, jún, september alebo december alebo posledný deň vykonávania činnosti správcu AIF. Údaj sa vyplňa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-dd. Povinný údaj.
- 8. V dátovom poli 8 „**Typ vykazovaného obdobia**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - A. ak frekvencia vykazovania je štvrt'ročná
 - a) „Q1“ pre prvý štvrt'rok kalendárneho roka,
 - b) „Q2“ pre druhý štvrt'rok kalendárneho roka,
 - c) „Q3“ pre tretí štvrt'rok kalendárneho roka,
 - d) „Q4“ pre štvrtý štvrt'rok kalendárneho roka,
 - B. ak frekvencia vykazovania je polročná
 - a) „H1“ pre prvý polrok,
 - b) „H2“ pre druhý polrok,
 - C. ak frekvencia vykazovania je ročná
 - „Y1“ pre kalendárny rok,
 - D. ak sa špecificky vyказuje za obdobie prvý až tretí štvrt'rok, na základe zmeny pre povinné vykazovanie údajov
 - „X1“ pre prvý až tretí štvrt'rok,
 - E. ak sa špecificky vyказuje za obdobie druhý až štvrtý štvrt'rok, na základe zmeny pre povinné vykazovanie údajov
 - „X2“ pre druhý až štvrtý štvrt'rok.

V rámci jedného kalendárneho roka sa nesmú jednotlivé vykazované obdobia prekrývať. Prípustné sú len nasledovné spôsoby vykazovania

 - a) Q1, Q2, Q3, Q4,
 - b) Q1, Q2, H2,
 - c) Q1, X2,
 - d) H1, H2,
 - e) H1, Q3, Q4,
 - f) Y1,
 - g) X1, Q4.

Povinný údaj.
- 9. V dátovom poli 9 „**Rok, za ktorý sa údaje vykazujú**“ sa uvádza rok, za ktorý sa údaje vykazujú. Vyplňa sa v tvare napríklad 2013, 2014 a podobne. Povinný údaj.

10. V dátovom poli 10 „**Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľkách č. 9 a 10 prílohy č. II usmernenia ESMA. Kód informuje o zmene frekvencie vykazovania povinných údajov. Nepovinný údaj.
11. V dátovom poli 11 „**Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 9 prílohy č. II usmernenia ESMA. Kód informuje o zmene obsahu povinne vykazovaných údajov. Nepovinný údaj.
12. V dátovom poli 12 „**Zmena štvrt'roku, počas ktorého dochádza k zmene frekvencie a/alebo obsahu povinne vykazovaných údajov**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 10 prílohy č. II usmernenia ESMA.
- Prípustné kódy pre príslušný štvrt'rok, v ktorom došlo k zmene frekvencie a/alebo obsahu povinne vykazovaných údajov sú nasledovné
- „Q1“ pre prvý štvrt'rok kalendárneho roka,
 - „Q2“ pre druhý štvrt'rok kalendárneho roka,
 - „Q3“ pre tretí štvrt'rok kalendárneho roka,
 - „Q4“ pre štvrtý štvrt'rok kalendárneho roka.
- Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 10 „Zmena kódu pre frekvenciu povinne vykazovaných údajov“ alebo 11 „Zmena kódu pre obsah povinne vykazovaných údajov“ uvedie príslušný kód. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
13. V dátovom poli 13 „**Posledný výkaz**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či ide o konečný výkaz alebo nie. Vypĺňa sa, ak AIF bol v likvidácii alebo došlo k zlúčeniu počas obdobia, za ktoré sa vykazuje. Uvádza sa kód podľa číselníka
- „true“ (áno) pre posledný výkaz,
 - „false“ (nie) pre ostatné prípady.
- Povinný údaj.
14. V dátovom poli 14 „**Číslo položky**“ sa uvádza číslo položky, na ktorú sa vzťahuje popis predpokladu. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 15 „Popis predpokladu“ uvedie informácia. V ostatných prípadoch sa nevypĺňa.
15. V dátovom poli 15 „**Popis predpokladu**“ sa uvádza voľný text týkajúci sa popisu predpokladu. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 14 „Číslo položky“ uvedie údaj. V ostatných prípadoch sa nevypĺňa.
16. V dátovom poli 16 „**Vnútroštátny identifikačný kód správcu AIF**“ sa uvádza unikátny identifikačný kód pridelený správcovi AIF v členskom štáte, v ktorom vykazuje údaje príslušnému orgánu. Povinný údaj.
17. V dátovom poli 17 „**Vnútroštátny identifikačný kód AIF**“ sa uvádza unikátny identifikačný kód pridelený AIF v členskom štáte, v ktorom správca AIF vykazuje údaje príslušnému orgánu. Vypĺňa sa kód, ktorý používajú vnútroštátne orgány

v domovskom členskom štáte na identifikáciu AIF, alebo vnútroštátne príslušné orgány referenčného členského štátu alebo vnútroštátne príslušné orgány členského štátu, kde správca AIF uvádza na trh AIF, ktoré spravuje. Povinný údaj.

18. V dátovom poli 18 „**Názov AIF**“ sa uvádza názov AIF. Ak ide o strešný fond, uvádza sa názov strešného fondu a podfondu. Povinný údaj.
19. V dátovom poli 19 „**AIF z EHP**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či AIF má sídlo v rámci Európskeho hospodárskeho priestoru (EHP) alebo v rámci Európskej únie (EÚ). Vypĺňa sa kód podľa číselníka
 - a) „true“ (áno) pre AIF z EHP alebo EÚ,
 - b) „false“ (nie) pre AIF zo štátu mimo EHP alebo mimo EÚ.Povinný údaj.
20. V dátovom poli 20 „**Kód pre kategóriu vykazovania AIF**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 9 prílohy č. II usmernenia ESMA. Povinný údaj.
21. V dátovom poli 21 „**Sídlo AIF**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Ak ide o AIF z EÚ, sídlom AIF sa rozumie domovský členský štát definovaný podľa § 3 písm. aa) zákona (čl. 4 ods. 1 písm. p) AIFMD). Ak ide o AIF zo štátu mimo EÚ, sídlom sa rozumie štát, v ktorom bolo AIF udelené povolenie alebo, v ktorej bol registrovaný alebo kde má svoje sídlo. Povinný údaj.
22. V dátovom poli 22 „**Dátum vzniku AIF**“ sa uvádza dátum, kedy AIF začal vykonávať svoju činnosť. Dátum vzniku AIF by nemal nasledovať po dátume uvedenom v dátovom poli 6 „Začiatok vykazovaného obdobia“. Vypĺňa sa podľa medzinárodnej normy ISO 8601 v tvare yyyy-mm-dd. Povinný údaj.
23. V dátovom poli 23 „**Informácia o nevykazovaní údajov za AIF**“ sa uvádza kód podľa číselníka
 - a) „true“ (áno) pre prázdny výkaz (nevykazujú sa žiadne údaje za vykazovacie obdobie),
 - b) „false“ (nie) pre ostatné prípady.Povinný údaj.
24. V dátovom poli 24 „**LEI kód AIF**“ sa uvádza LEI kód AIF podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, uvádza sa IEI kód. Nepovinný údaj.
25. V dátovom poli 25 „**ISIN kód AIF**“ sa uvádza ISIN kód podľa medzinárodnej normy ISO 6166, ak je dostupný. Nepovinný údaj.
26. V dátovom poli 26 „**CUSIP kód AIF**“ sa uvádza CUSIP kód, ak je dostupný. Nepovinný údaj.
27. V dátovom poli 27 „**SEDOL kód AIF**“ sa uvádza SEDOL kód, ak je dostupný. Nepovinný údaj.

28. V dátovom poli 28 „**Bloomberg kód AIF**“ sa uvádza Bloomberg ticker symbol, ak je dostupný. Nepovinný údaj.
29. V dátovom poli 29 „**Reuters kód AIF**“ sa uvádza RIC kód, ak je dostupný. Nepovinný údaj.
30. V dátovom poli 30 „**ECB kód AIF**“ sa uvádza kód pridelený Európskou centrálnou bankou, ak je dostupný. Nepovinný údaj.
31. V dátovom poli 31 „**Vnútroštátny identifikátor predchodcu AIF – vykazujúci členský štát**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa kód členského štátu, v ktorom správca AIF vykazuje údaje, ak sa zmenil kód uvedený v dátovom poli 17 „Vnútroštátny identifikačný kód AIF“. Vypĺňa sa povinne len, ak sa vyplnil údaj v dátovom poli 32 „Vnútroštátny identifikátor predchodcu AIF – vnútroštátny identifikačný kód“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
32. V dátovom poli 32 „**Vnútroštátny identifikátor predchodcu AIF – vnútroštátny identifikačný kód**“ sa uvádza vnútroštátny identifikačný kód AIF predchodcu, ktorý sa vykazuje ak došlo k jeho zmene (údaj sa vypĺňa v prvom výkaze nasledujúcom po zmene vnútroštátneho identifikátora a v každom ďalšom výkaze). Vypĺňa sa povinne len, ak sa vyplnil údaj v dátovom poli 31 „Vnútroštátny identifikátor predchodcu AIF – vykazujúci členský štát“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
33. V dátovom poli 33 „**Trieda akcií AIF**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či AIF má niekoľko tried akcií. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- „true“ (áno) pre AIF s niekoľkými triedami akcií,
 - „false“ (nie) pre ostatné prípady.
- Povinný údaj.
34. V dátovom poli 34 „**Vnútroštátny identifikačný kód triedy akcií**“ sa uvádza unikátny identifikačný kód, ak je dostupný, pre každú triedu akcií pridelený príslušným vnútroštátnym kompetentným orgánom, ktorému správca AIF vykazuje údaje. Dátové pole sa nevypĺňa, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
35. V dátovom poli 35 „**ISIN kód triedy akcií**“ sa uvádza ISIN kód identifikujúci každú triedu akcií, ak je dostupný. Kód sa vypĺňa podľa medzinárodnej normy ISO 6166. Dátové pole sa nevypĺňa, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
36. V dátovom poli 36 „**SEDOL kód triedy akcií**“ sa uvádza SEDOL kód identifikujúci každú triedu akcií, ak je dostupný. Dátové pole sa nevypĺňa, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

37. V dátovom poli 37 „**CUSIP kód triedy akcií**“ sa uvádza CUSIP kód identifikujúci každú triedu akcií, ak je dostupný. Dátové pole sa nevyplní, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
38. V dátovom poli 38 „**Bloomberg kód triedy akcií**“ sa uvádza Bloomberg ticker symbol identifikujúci každú triedu akcií, ak je dostupný. Dátové pole sa nevyplní, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
39. V dátovom poli 39 „**Reuters kód triedy akcií**“ sa uvádza RIC kód identifikujúci každú triedu akcií, ak je dostupný. Dátové pole sa nevyplní, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
40. V dátovom poli 40 „**Názov triedy akcií**“ sa uvádza názov triedy akcií. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 33 „Trieda akcií“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
41. V dátovom poli 41 „**Postavenie AIF v štruktúre hlavný fond a zberný fond**“ sa uvádza kód podľa číselníka
- „MASTER“ pre hlavný AIF,
 - „FEEDER“ pre zberný AIF,
 - „NONE“ pre ostatné prípady.
- Povinný údaj.
42. V dátovom poli 42 „**Názov hlavného AIF**“ sa uvádza názov hlavného AIF v úplnom znení tak, ako ho poskytuje spoločnosť SWIFT pre hlavný AIF, ktorý má pridelený BIC kód alebo LEI kód. Povinný údaj, ak sa v dátovom poli 41 „Postavenie AIF v štruktúre hlavný fond a zberný fond“ uvedie kód „FEEDER“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
43. V dátovom poli 43 „**Vnútroštátny identifikátor hlavného AIF – vykazujúci členský štát**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa kód členského štátu, v ktorom správca hlavného AIF vykazuje údaje. Nepovinný údaj, ak sa v dátovom poli 41 „Postavenie AIF v štruktúre hlavný fond a zberný fond“ uvedie kód „FEEDER“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
44. V dátovom poli 44 „**Vnútroštátny identifikátor hlavného AIF – vnútroštátny identifikačný kód**“ sa uvádza unikátny identifikačný kód pridelený hlavnému AIF vnútroštátnym kompetentným orgánom, ktorému správca hlavného AIF vykazuje údaje. Povinný údaj, ak sa vyplní dátové pole 43 „Vnútroštátny identifikátor hlavného AIF – vykazujúci členský štát“. Nepovinný údaj, ak sa v dátovom poli 41 „Postavenie AIF v štruktúre hlavný fond a zberný fond“ uvedie kód „FEEDER“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

45. V dátovom poli 45 „**Názov primárneho brokera**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu. Ak LEI kód nie je dostupný, uvádza sa názov zodpovedajúci BIC kódu, ak existuje. Nepovinný údaj.
46. V dátovom poli 46 „**LEI kód primárneho brokera**“ sa uvádza LEI kód podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, uvádza sa IEI kód. Nepovinný údaj.
47. V dátovom poli 47 „**BIC kód primárneho brokera**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nepovinný údaj.
48. V dátovom poli 48 „**Celková hodnota spravovaných aktív AIF (AuM) v základnej mene**“ sa uvádza celková hodnota spravovaných aktív všetkých AIF vypočítaná metódou podľa čl. 2 a 10 delegovaného nariadenia (EÚ) č. 231/2013. Hodnota sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vypĺňa sa hodnota vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Povinný údaj.
49. V dátovom poli 49 „**Základná mena AIF**“ sa uvádza kód základnej meny, a to trojznakový, podľa medzinárodnej normy ISO 4217, ktorý bol použitý na účely vykazovania údajov. Môže byť použitá len jedna mena. Ak AIF má viacero tried akcií denominované v rôznych menách, uvedie sa len jedna hlavná základná mena. Povinný údaj.
50. V dátovom poli 50 „**Základná mena / EUR FX kurz**“ sa uvádza výmenný kurz s presnosťou na štyri desatinné miesta. Vypĺňa sa povinne len, ak základná mena AIF je iná ako mena euro. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
51. V dátovom poli 51 „**Základná mena / EUR typ referenčného FX kurzu**“ sa uvádza kód podľa číselníka
- „ECB“, ak základná mena je jedna z mien, pre ktorú výmenný kurz je eurový referenčný kurz zverejnený Európskou centrálnou bankou,
 - „OTH“ pre ostatné prípady.
- Vypĺňa sa povinne len, ak základná mena AIF je iná ako mena euro. Referenčný kurz ECB je zverejňovaný denne, keď je otvorený TARGET systém. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
52. V dátovom poli 52 „**Základná mena / EUR popis referenčného FX kurzu, ktorý nie je určený ECB**“ sa uvádza názov zdroja eurového referenčného kurzu použitého v dátovom poli 51 „Základná mena / EUR typ referenčného FX kurzu“. Ak sa v dátovom poli 51 uvedie kód „OTH“ (to znamená, ak príslušný eurový referenčný kurz nie je zverejňovaný Európskou centrálnou bankou), vypĺňa sa povinne, a to voľný text. Ak sa v dátovom poli 51 uvedie kód „ECB“ (to znamená, ak sa príslušný eurový referenčný kurz zverejňuje Európskou centrálnou bankou), pole sa nevypĺňa.

53. V dátovom poli 53 „**Celková čistá hodnota aktív AIF**“ sa uvádza celková čistá hodnota aktív (NAV) AIF. Hodnota sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vypĺňa sa hodnota bez desatinných miest. Povinný údaj.
54. V dátovom poli 54 „**Krajina prvého hlavného zdroja financovania**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa názov štátu prvého hlavného zdroja financovania, to znamená, že správca AIF identifikuje štát, v ktorom je usadená protistrana ako nositeľ záväzku. Nepovinný údaj.
55. V dátovom poli 55 „**Krajina druhého hlavného zdroja financovania**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa názov štátu druhého hlavného zdroja financovania, to znamená, že správca AIF identifikuje štát, v ktorom je usadená protistrana ako nositeľ záväzku. Nepovinný údaj.
56. V dátovom poli 56 „**Krajina tretieho hlavného zdroja financovania**“ sa uvádza kód krajiny podľa medzinárodnej normy ISO 3166-1. Vypĺňa sa názov štátu tretieho hlavného zdroja financovania, to znamená, že správca AIF identifikuje štát, v ktorom je usadená protistrana ako nositeľ záväzku. Nepovinný údaj.
57. V dátovom poli 57 „**Prevažujúci druh AIF**“ sa uvádza najviac zodpovedajúci typ AIF na základe čistej hodnoty aktív AIF (NAV) spomedzi typov AIF uvedených v číselníku. Správca AIF vyberá len jeden prevažujúci druh AIF. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- „HFND“ pre Hedžový fond,
 - „PEQF“ pre Fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií,
 - „REST“ pre Fond investujúci do nehnuteľností,
 - „FOFS“ pre Fond fondov,
 - „OTHR“ pre Iné fondy,
 - „NONE“ pre žiadne fondy (uvádza sa len, ak investičná stratégia nepovoľuje identifikáciu prevažujúceho druhu AIF).
- Povinný údaj.
58. V dátovom poli 58 „**Kód investičnej stratégie**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 3 prílohy č. II usmernenia ESMA. Investičné stratégie sa navzájom vylučujú, okrem prípadu, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „NONE“. Neprirodajú sa stratégie naprieč rôznymi skupinami stratégií. Napríklad, ak sa vykáže ako prevažujúci druh AIF hedžový fond, vyberú sa zo zoznamu stratégií iba tie, ktoré patria k hedžovému fondu. Ak sa uvedie ako prevažujúci druh AIF „NONE“, vykážu sa investičné stratégie naprieč rôznymi skupinami prevažujúcich druhov AIF. Ak sa v bloku <HedgeFundStrategyType> uvedie kód „MULT_HFND“, vykážu sa aspoň dva odlišné kódy pre iné stratégie. Ak sa v bloku <PrivateEquityFundStrategyType> uvedie kód „MULT_PEQF“, vykážu sa aspoň dva odlišné kódy pre iné stratégie. Ak sa v bloku <RealEstateFundStrategyType> uvedie kód „MULT_REST“, vykážu sa aspoň dva odlišné kódy pre iné stratégie. Vypĺňa sa povinne pre každý blok stratégie.

59. V dátovom poli 59 „**Označenie, či podstratégia najlepšie opisuje stratégiu AIF**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či stratégia fondu je hlavnou stratégiou. Existuje len jedna hlavná investičná stratégia. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- „true“ (áno) pre hlavnú stratégiu,
 - „false“ (nie) pre ostatné prípady.
- Kód „true“ sa vyberá vtedy, ak sa v dátovom poli 58 „Kód investičnej stratégie“ uvedie kód „MULT_HFND“, „MULT_PEQF“, alebo „MULT_REST“. Vypĺňa sa povinne pre každý blok stratégie.
60. V dátovom poli 60 „**Podiel na čistej hodnote aktív v %**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív, vyjadrený v percentách, pre každú vykazovanú investičnú stratégiu. Súčet všetkých podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 58 „Kód investičnej stratégie“ uvedie iný kód ako kódy „MULT_HFND“, „MULT_PEQF“, alebo „MULT_REST“.
61. V dátovom poli 61 „**Popis pre druh stratégie AIF „Iný fond**““ sa uvádza popis príslušnej stratégie. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 58 „Kód investičnej stratégie“ uvedie niektorý z nasledovných kódov
- „OTHR_HFND“ pre inú stratégiu hedžového fondu,
 - „OTHR_PEQF“ pre inú stratégiu fondu investujúceho do verejne neobchodovateľných akcií,
 - „OTHR_REST“ pre inú stratégiu fondu investujúceho do nehnuteľností,
 - „OTHR_FOFS“ pre inú stratégiu fondu fondov,
 - „OTHR_OTHF“ pre inú stratégiu iného fondu.
- Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
62. V dátovom poli 62 „**Počet transakcií podľa HFT**“ sa uvádza celkový počet transakcií uskutočnený použitím metódy automatizovaného algoritmického obchodovania (HFT), ktorou sa rozumie akákoľvek metóda algoritmického obchodovania, ktorú charakterizuje: a) infraštruktúra zameraná na minimalizáciu sieťového a iného oneskorovania vrátane aspoň jedného z týchto nástrojov algoritmického vstupu pokynov: kolokácia, proximity hosting alebo vysokorýchlostný priamy elektronický prístup; b) systém určovania iniciácie, generovania, smerovania alebo vykonania pokynov bez zásahu človeka pri jednotlivých obchodoch alebo pokynoch; a c) vysoký počet správ v rámci príslušného dňa, ktoré predstavujú pokyny, kotácie alebo zrušenia. Nepovinný údaj.
63. V dátovom poli 63 „**Trhová hodnota nákupov a predajov v základnej mene podľa HFT**“ sa uvádza trhová hodnota nákupov a predajov v základnej mene AIF za vykazované obdobie zodpovedajúca celkovému počtu transakcií uskutočnenému použitím metódy automatizovaného algoritmického obchodovania (HFT). Vypĺňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
64. V dátovom poli 64 „**Poradie**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvý hlavný podtyp aktíva / nástroja / druhu pozície,
- b) „2“ pre druhý hlavný podtyp aktíva / nástroja / druhu pozície,
- c) „3“ pre tretí hlavný podtyp aktíva / nástroja / druhu pozície,
- d) „4“ pre štvrtý hlavný podtyp aktíva / nástroja / druhu pozície,
- e) „5“ pre piaty hlavný podtyp aktíva / nástroja / druhu pozície.

Táto informácia sa poskytuje za každý AIF alebo, ak správca AIF spravuje strešný AIF, ktorý sa skladá z viacerých podfondov, za každý podfond samostatne. Identifikuje sa päť najdôležitejších nástrojov AIF. Poradie je založené na hodnote jednotlivých nástrojov. Hodnota nástrojov sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Povinný údaj.

65. V dátovom poli 65 „**Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj**“ sa uvádza kód podtypu aktíva, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (najvyššia úroveň dostupných detailov). Ak správca AIF vykazuje menej ako päť nástrojov pre príslušný AIF, uvádza sa pre príslušné poradie kód „NTA_NTA_NOTA“. Povinný údaj.

66. V dátovom poli 66 „**Druh kódu nástroja**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „NONE“ pre nástroj, ktorý nemá pridelený kód (uvádza sa pre aktíva, ktoré nemajú konkrétny kód nástroja – napríklad drevo alebo vinice – a podrobnosti sa uvedú v dátovom poli 67 „Názov nástroja“),
- b) „ISIN“ pre nástroj, ktorý má pridelený kód ISIN,
- c) „AII“ pre nástroj, ktorý má pridelený kód AII (uvádza sa pre deriváty).

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 65 „Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA_NOTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

67. V dátovom poli 67 „**Názov nástroja**“ sa uvádza krátky názov nástroja tak, ako je určený spoločnosťou SWIFT podľa medzinárodnej normy ISO 18774, ak je dostupný. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 65 „Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj“ uvedie kód iný ako „NTA_NTA_NOTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

68. V dátovom poli 68 „**ISIN kód nástroja**“ sa uvádza ISIN kód nástroja podľa medzinárodnej normy ISO 6166, ak je dostupný. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „ISIN“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

69. V dátovom poli 69 „**AII kód nástroja – Burzový kód**“ sa uvádza štvorznakový MIC kód trhu, na ktorom bol derivát prijatý na obchodovanie. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

70. V dátovom poli 70 „**AII kód nástroja – Burzový kód produktu**“ sa uvádza kód, ktorý je jedinečne spojený s konkrétnym podkladovým nástrojom, typom vyrovnania a ďalšími charakteristikami kontraktu (dĺžka je od 1 do 12 znakov). Vypĺňa sa

povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

71. V dátovom poli 71 „**AII kód nástroja – Derivátový typ**“ sa uvádza kód podľa číselníka

a) „O“ pre opciu,

b) „F“ pre futures.

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

72. V dátovom poli 72 „**AII kód nástroja – Put/Call indentifikátor**“ sa uvádza kód podľa číselníka

a) „P“ pre put opciu,

b) „C“ pre call opciu.

Ak ide o futures, pole sa nevypĺňa. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

73. V dátovom poli 73 „**AII kód nástroja – Platnosť/Dátum dodania**“ sa uvádza dátum, kedy sa opcia môže predat' alebo kúpiť (exercise date) a dátum splatnosti (maturity date) derivátového kontraktu. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

74. V dátovom poli 74 „**AII kód nástroja – Realizačná cena**“ sa uvádza realizačná cena opcie alebo iného finančného nástroja. Ak ide o futures, realizačná cena obsahuje hodnotu „0“. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 66 „Druh kódu nástroja“ uvedie kód „AII“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

75. V dátovom poli 75 „**Druh pozície (dlhá/krátka)**“ sa uvádza kód podľa číselníka

a) „L“ (long) pre dlhú pozíciu,

b) „S“ (short) pre krátku pozíciu.

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 65 „Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA_NOTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

76. V dátovom poli 76 „**Hodnota pozície nástroja (vypočítaná podľa § 189a) (čl. 3 AIFMD)**“ sa uvádza hodnota pozície nástroja vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 65 „Kód podtypu aktíva pre príslušný nástroj“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA_NOTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

77. V dátovom poli 77 „**Hedžing v % pre krátku pozíciu**“ sa uvádza pre krátku pozíciu indikátor, ktorý vyjadruje, či pozícia je použitá na hedžovanie pozície s podobnou ekonomickou expozíciou. Nepovinný údaj, ak sa v dátovom poli 75 „Druh pozície (dlhá/krátka)“ uvedie kód „S“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

78. V dátovom poli 78 „**Afrika - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Údaj sa vykazuje k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Niektoré geografické oblasti môžu vykazovať záporné hodnoty, zatiaľ čo iné geografické oblasti môžu vykazovať hodnotu nad 100 %. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
- Pri vykazovaní informácií o geografickom zameraní je dôležité, aby správca AIF pozeral na sídlo vykonanej investície. Pre nástroje finančných derivátov (OTC a kótované deriváty) sa sídlom rozumie sídlo podkladového aktíva. Pre hotovostné bankové vklady sa sídlo viaže na menu, v ktorej je vklad denominovaný (napríklad, ak je hotovostný vklad v banke v USA v eurách, sídlom je Európa). Pre hotovostné výpožičky sa sídlo viaže na menu požičanej hotovosti, a nie na sídlo požičiadateľa. Podrobné členenie jednotlivých geografických oblastí je uvedené v tabuľke č. 1 prílohy č. III usmernenia ESMA.
79. V dátovom poli 79 „**Ázia a Tichý oceán (okrem Blízkeho východu) - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
80. V dátovom poli 80 „**Európa (okrem EHP) - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
81. V dátovom poli 81 „**Európa (EHP) - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
82. V dátovom poli 82 „**Blízky Východ - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
83. V dátovom poli 83 „**Severná Amerika - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
84. V dátovom poli 84 „**Južná Amerika - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.
85. V dátovom poli 85 „**Nadnárodný/viac regiónov - % z čistej hodnoty aktív AIF**“ sa uvádza podiel na čistej hodnote aktív (NAV) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Táto kategória sa použije, ak správca AIF má také investície, ktoré nemajú prevládajúce geografické zameranie a nie je možné ich zaradiť do konkrétnej geografickej oblasti. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Povinný údaj.

86. V dátovom poli 86 „**Afrika - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
87. V dátovom poli 87 „**Ázia a Tichý oceán (okrem Blízkeho východu) - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
88. V dátovom poli 88 „**Európa (okrem EHP) - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
89. V dátovom poli 89 „**Európa (EHP) - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
90. V dátovom poli 90 „**Blízky Východ - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
91. V dátovom poli 91 „**Severná Amerika - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
92. V dátovom poli 92 „**Južná Amerika - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
93. V dátovom poli 93 „**Nadnárodný/viac regiónov - % z celkovej hodnoty spravovaných aktív**“ sa uvádza podiel na celkovej hodnote spravovaných aktív (AUM) vyjadrený v percentách pre túto geografickú oblasť. Súčet podielov všetkých geografických oblastí sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
94. V dátovom poli 94 „**Poradie**“ sa uvádza poradie desiatich hlavných expozícií odvodených od podtypu aktíva a typu pozície (dlhá/ krátka). Nástroje sa zoskupia podľa kategórií podtypu aktív uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA a potom sa vykáže desať hlavných expozícií. Hodnotenie je založené na

agregovanej hodnote nástrojov, ktoré tvoria príslušnú kategóriu podtypu aktíva. Hodnota sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vyplňa sa kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvú hlavnú expozíciu,
- b) „2“ pre druhú hlavnú expozíciu,
- c) „3“ pre tretiu hlavnú expozíciu,
- d) „4“ pre štvrtú hlavnú expozíciu,
- e) „5“ pre piatu hlavnú expozíciu,
- f) „6“ pre šiestu hlavnú expozíciu,
- g) „7“ pre siedmu hlavnú expozíciu,
- h) „8“ pre ôsmu hlavnú expozíciu,
- i) „9“ pre deviatu hlavnú expozíciu,
- j) „10“ pre desiatu hlavnú expozíciu.

Povinný údaj.

95. V dátovom poli 95 „**Makro typ aktíva**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (prvá úroveň dostupných detailov). Ak AIF má menej ako desať rôznych expozícií, uvádza sa v každej chýbajúcej pozícii kód „NTA“. Povinný údaj.

96. V dátovom poli 96 „**Podtyp aktíva**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (najvyššia úroveň dostupných detailov). Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 95 „Makro typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

97. V dátovom poli 97 „**Druh pozície (dlhá/krátka)**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „L“ (long) pre dlhú pozíciu,
- b) „S“ (short) pre krátku pozíciu.

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 95 „Makro typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

98. V dátovom poli 98 „**Celková hodnota**“ sa uvádza agregovaná hodnota pre každú kategóriu podtypu aktíva, vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 95 „Makro typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

99. V dátovom poli 99 „**Celková hodnota v percentách**“ sa uvádza agregovaná hodnota vyjadrená v percentách z celkovej hodnoty aktív v držbe AIF pre každý podtyp aktíva. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 95 „Makro typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

100. V dátovom poli 100 „**Názov protistrany**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Nepovinný údaj.

Ak správca AIF pozná protistranu OTC transakcií, vyplňajú sa dátové polia 100, 101 a 102. V takomto prípade sa centrálné protistrany nepovažujú za protistranu. Ak pre jednu kategóriu podtypu aktív existuje viac ako jedna protistrana, správca AIF neuvádza protistranu. Protistrany, ktoré sú súčasťou rovnakej skupiny, sa považujú za jednu protistranu. Ak nemajú všetky nástroje rovnakú protistranu, dátové pole sa nevyplňa.

101. V dátovom poli 101 „**LEI kód protistrany**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. LEI kód sa nemôže vyplňať, ak nie je vyplnené dátové pole 100 „Názov protistrany“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

102. V dátovom poli 102 „**BIC kód protistrany**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. BIC kód sa nemôže vyplňať, ak nie je vyplnené dátové pole 100 „Názov protistrany“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

103. V dátovom poli 103 „**Poradie**“ sa uvádza poradie piatich najdôležitejších koncentrácií v portfóliu podľa typu aktíva, podľa trhu, kde sa s ním obchoduje a druhu pozície. Poradie je založené na agregovanej hodnote nástrojov tvoriacich každý typ aktíva. Hodnota sa vypočíta k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vyplňa sa kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvú dôležitú koncentráciu v portfóliu,
- b) „2“ pre druhú dôležitú koncentráciu v portfóliu,
- c) „3“ pre tretiu dôležitú koncentráciu v portfóliu,
- d) „4“ pre štvrtú dôležitú koncentráciu v portfóliu,
- e) „5“ pre piatu dôležitú koncentráciu v portfóliu.

Povinný údaj.

104. V dátovom poli 104 „**Typ aktíva**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (druhá úroveň dostupných detailov). Ak AIF má menej ako päť rôznych koncentrácií, pre každé chýbajúce poradie sa uvedie kód „NTA_NTA“. Povinný údaj.

105. V dátovom poli 105 „**Druh pozície (dlhá/krátka)**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „L“ (long) pre dlhú pozíciu,
- b) „S“ (short) pre krátku pozíciu.

Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 104 „Typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA“. Nevyplňa sa v ostatných prípadoch.

106. V dátovom poli 106 „**Kód pre typ trhu**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „MIC“ pre trhy s MIC kódmi,
- b) „OTC“ pre mimoburzové transakcie (uvádza sa, ak správca AIF investuje prostredníctvom mimoburzových transakcií do nástroja, ktorý je tiež kótovaný na trhu),
- c) „XXX“, ak neexistuje žiadny trh (medzi tieto nástroje patria napríklad podniky kolektívneho investovania).

Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 104 „Typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

107.V dátovom poli 107 „**Kód trhu**“ sa uvádza MIC kód podľa medzinárodnej normy ISO 10383 pre obchodné miesto, na ktorom je príslušná kategória investície obchodovaná. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 106 „Kód pre typ trhu“ uvedie kód „MIC“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

108.V dátovom poli 108 „**Celková hodnota**“ sa uvádza celková hodnota pre každý typ aktíva, trh a druh pozície v základnej mene, bez desatinných miest. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 104 „Typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

109.V dátovom poli 109 „**Celková hodnota v percentách**“ sa uvádza podiel celkovej hodnoty v percentách pre každý typ aktíva, trh a druh pozície. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 104 „Typ aktíva“ uvedie iný kód ako „NTA_NTA“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

110.V dátovom poli 110 „**Názov protistrany**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 106 „Kód pre typ trhu“ uvádza iný kód ako „OTC“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

111.V dátovom poli 111 „**LEI kód protistrany**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, uvádza sa IEI kód. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 106 „Kód pre typ trhu“ uvádza iný kód ako „OTC“ alebo, ak v dátovom poli 110 „Názov protistrany“ nie je uvedený názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

112.V dátovom poli 112 „**BIC kód protistrany**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 106 „Kód pre typ trhu“ uvádza iný kód ako „OTC“ alebo, ak v dátovom poli 110 „Názov protistrany“ nie je uvedený názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

113.V dátovom poli 113 „**Vyberá sa jedna veľkosť pozície**“ sa uvádza kategória veľkosti obchodu/pozície, ktorá je typická pre prevažujúci druh AIF „fond investujúci do verejne neobchodovateľných akcií“. Vyberá sa iba jedna veľkosť obchodu/pozície, a to taká, v ktorej AIF obvykle investuje. Vypĺňa sa kód podľa číselníka

- a) „V_SMALL“ pre „veľmi malý“ – v pásme menej ako 5 mil. eur,
- b) „SMALL“ pre „malý“ - v pásme od 5 mil. eur do 25 mil. eur,
- c) „LOW_MID_MKT“ pre „menší/stredný trh“ - v pásme od 25 mil. eur do 150 mil. eur,

- d) „UP_MID_MKT“ pre „väčší/stredný trh“ - v pásme od 150 mil. eur do 500 mil. eur,
- e) „L_CAP“ pre „veľký“ - v pásme od 500 mil. eur do 1 mld. eur,
- f) „M_CAP“ pre „veľmi veľký“ - v pásme 1 mld. eur a viac.

Kód sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 4 prílohy č. II usmernenia ESMA. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

114. V dátovom poli 114 „**Poradie**“ sa uvádza poradie troch hlavných trhov, na ktorých AIF obchoduje. Vyplňa sa kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvý hlavný trh,
- b) „2“ pre druhý hlavný trh,
- c) „3“ pre tretí hlavný trh.

Povinný údaj.

115. V dátovom poli 115 „**Kód pre typ trhu**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „NOT“, ak neexistuje žiadny trh pre vykazovanie v danom poradí,
- b) „MIC“ pre trhy s MIC kódmi,
- c) „OTC“ pre OTC deriváty,
- d) „XXX“ pre transakcie, ktoré sú obchodované mimo akéhokoľvek trhu.

Povinný údaj.

116. V dátovom poli 116 „**Kód trhu**“ sa uvádza MIC kód podľa medzinárodnej normy ISO 10383 pre príslušné obchodné miesto. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 115 „Kód pre typ trhu“ uvedie kód „MIC“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

117. V dátovom poli 117 „**Celková hodnota**“ sa uvádza celková hodnota nástrojov agregovaných na úrovni troch najdôležitejších trhov, na ktorých AIF obchoduje, v základnej mene, bez desatinných miest. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 115 „Kód pre typ trhu“ uvedie iný kód ako „NOT“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

118. V dátovom poli 118 „**Uvádza sa približný percentuálny podiel vlastného kapitálu AIF, ktorý je v skutočnom vlastníctve piatich nominálnych vlastníkov, ktorí majú najväčšiu účasť na vlastnom kapitáli AIF**“ sa uvádza podiel vyjadrený v percentách. Zoskupí sa päť nominálnych vlastníkov, ktorí majú najväčší majetkový podiel v AIF. Investori, ktorí sú súčasťou jednej skupiny, sa považujú za jedného investora. Povinný údaj.

119. V dátovom poli 119 „**Profesionálni klienti**“ sa uvádza podiel vyjadrený v percentách. Súčet podielov vykazovaných profesionálnych klientov a retailových klientov sa rovná 100 %. Povinný údaj. Pojem profesionálni klienti je vymedzený v § 8a zákona č. 566/2001 Z. z. o cenných papieroch a investičných službách a o zmene a doplnení niektorých zákonov (zákon o cenných papieroch) v znení neskorších predpisov.

120. V dátovom poli 120 „**Retailoví investori**“ sa uvádza podiel vyjadrený v percentách. Súčet podielov vykazovaných profesionálnych klientov a retailových klientov sa rovná 100 %. Povinný údaj.
121. V dátovom poli 121 „**Kód podtypu aktíva**“ sa uvádza podtyp aktíva pre jednotlivé expozície, s ktorými AIF obchoduje, ku dňu vypracovania výkazu. Vypĺňa sa kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 1 prílohy č. II usmernenia ESMA (najvyššia úroveň dostupných detailov). Povinný údaj. Podtyp aktíva s kódom „NTA_NTA_NOTA“ sa v tomto poli nevypĺňa. Vymedzenie obsahu jednotlivých kategórií aktív na účely tohto výkazu sa nachádza v bode 304 metodiky.
122. V dátovom poli 122 „**Hrubá hodnota**“ sa uvádza hrubá hodnota v základnej mene, bez desatinných miest, a to vtedy, ak sa v dátovom poli 121 „Kód podtypu aktíva“ uvedie kód „DER_FEX_INVT“, „DER_FEX_HEDG“ a „DER_IRD_INTR“. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 121 uvedie iný kód, ako sú uvedené v predchádzajúcej vete. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
123. V dátovom poli 123 „**Dlhá hodnota**“ sa uvádza dlhá hodnota pre každý podtyp aktíva s kódom iným ako „DER_FEX_INVT“, „DER_FEX_HEDG“ a „DER_IRD_INTR“ s hodnotou dlhej pozície. Vypĺňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 121 „Kód podtypu aktíva“ uvedie rovnaký kód, ako sú uvedené v predchádzajúcej vete. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
124. V dátovom poli 124 „**Krátka hodnota**“ sa uvádza krátka hodnota pre každý podtyp aktíva s kódom iným ako „DER_FEX_INVT“, „DER_FEX_HEDG“ a „DER_IRD_INTR“ s hodnotou krátkej pozície. Vypĺňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 121 „Kód podtypu aktíva“ uvedie rovnaký kód, ako sú uvedené v predchádzajúcej vete. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
125. V dátovom poli 125 „**Kód podtypu aktíva**“ sa uvádza kód, ktorý sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 2 prílohy č. II usmernenia ESMA. Povinný údaj.
126. V dátovom poli 126 „**Trhová hodnota**“ sa uvádza trhová hodnota obratu každého príslušného podtypu aktíva za vykazované mesiace, vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
127. V dátovom poli 127 „**Nominálna hodnota**“ sa uvádza nominálna hodnota obratu každého príslušného podtypu aktíva za vykazované mesiace, vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Nominálna hodnota sa vyказuje len pre derivátové podtypy aktív (to znamená pre kódy „DER_EQD_EQD“, „DER_FID_FID“,

„DER_CDS_CDS“, „DER_FEX_INV“, „DER_FEX_HED“, „DER_IRD_IRD“, „DER_CTY_CTY“, „DER_OTH_OTH“). Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch. Ak sa za vykazované obdobie neuskutoční žiadny obchod, vyplňa sa dátové pole „Total other“ s kódom podtypu aktíva „OTH_OTH_OTH“ tak, že sa uvedie hodnota „0“.

128. V dátovom poli 128 „**Mena expozície**“ sa uvádza kód meny, a to trojznakový, podľa medzinárodnej normy ISO 4217 pre každú menu expozície. Nepovinný údaj.

129. V dátovom poli 129 „**Hodnota menovej dlhej pozície**“ sa uvádza hodnota dlhej pozície pre každú menovú expozíciu, bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 128 „Mena expozície“ neuvedie žiadny kód meny. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

130. V dátovom poli 130 „**Hodnota menovej krátkej pozície**“ sa uvádza hodnota krátkej pozície pre každú menovú expozíciu, bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 128 „Mena expozície“ neuvedie žiadny kód meny. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

131. V dátovom poli 131 „**Názov spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch. Ide o rozhodujúci vplyv podľa vymedzenia v zákone č. 431/2002 Z. z. o účtovníctve v znení neskorších predpisov.

132. V dátovom poli 132 „**LEI kód spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. Nepovinný údaj, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie iný kód ako „PEQF“.

133. V dátovom poli 133 „**BIC kód spoločnosti, v ktorej má AIF rozhodujúci vplyv**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nepovinný údaj, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie iný kód ako „PEQF“. BIC kód sa uvádza vtedy, ak nie je k dispozícii LEI kód alebo IEI kód.

134. V dátovom poli 134 „**Typ transakcie**“ sa uvádza kód pre príslušný typ transakcie podľa číselníka

- a) „ACAP“ pre akvizičný kapitál (Acquisition capital),
- b) „BOUT“ pre odkúpenie podielu vo firme (Buyouts),
- c) „CONS“ pre konsolidáciu (ukončenie odvetvia) (Consolidations (industry roll-ups)),
- d) „CDIV“ pre podnikové odpredaje (Corporate Divestitures),

- e) „ESOP“ pre plány kolektívnej kapitálovej účasti (Employee Stock Ownership Plans),
- f) „GCAP“ pre rastový kapitál (Growth Capital),
- g) „RCAP“ pre rekapitalizáciu (Recapitalisation),
- h) „SLIQ“ pre likviditu akcionárov (Shareholder Liquidity),
- i) „TURN“ pre obrat (Turnarounds),
- j) „OTHR“ pre iný typ transakcie (Other transaction type).

Kód sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 5 prílohy č. II usmernenia ESMA. Vyberá sa len jeden typ transakcie. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

135. V dátovom poli 135 „**Popis pre „iný“ typ transakcie**“ sa vypĺňa voľný text pre vysvetlenie povahy transakcie. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 134 „Typ transakcie“ uvedie kód „OTHR“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

136. V dátovom poli 136 „**% hlasovacích práv**“ sa uvádza podiel vyjadrený v percentách. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 57 „Prevažujúci druh AIF“ uvedie kód „PEQF“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

137. V dátovom poli 137 „**Očakávaný ročný výnos z investície/vnútoraná miera návratnosti (IRR) za bežných trhových podmienok (v %)**“ sa uvádza očakávaný ročný výnos z investície/vnútoraná miera návratnosti (IRR) za bežných trhových podmienok vyjadrená v percentách. Ak nie je k dispozícii údaj pre toto dátové pole, uvedie sa hodnota „NA“ (non-applicable). Povinný údaj.

138. V dátovom poli 138 „**Druh miery rizika**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „NET_EQUITY_DELTA“ pre Net Equity Delta,
- b) „NET_DV01“ pre Net DV01,
- c) „NET_CS01“ pre Net CS01,
- d) „VAR“ pre VaR,
- e) „NET_FX_DELTA“ pre Net FX Delta (citlivosť portfólia na zmeny FX kurzu),
- f) „NET_CTY_DELTA“ pre Net Commodity Delta (citlivosť portfólia na zmeny cien komodít),
- g) „VEGA_EXPO“ pre Vega expozíciu.

Nepovinný údaj.

139. V dátovom poli 139 „**Hodnota miery rizika**“ sa uvádza hodnota len pre nasledovné druhy miery rizika „NET_EQUITY_DELTA“, „NET_FX_DELTA“ a „NET_CTY_DELTA“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

140. V dátovom poli 140 „**Hodnota miery rizika pre pásmo < 5 rokov**“ sa uvádza hodnota len pre nasledovné druhy miery rizika „NET_DV01“ a „NET_CS01“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

141. V dátovom poli 141 „**Hodnota miery rizika pre pásmo 5-15 rokov**“ sa uvádza hodnota len pre nasledovné druhy miery rizika „NET_DV01“ a „NET_CS01“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
142. V dátovom poli 142 „**Hodnota miery rizika pre pásmo > 15 rokov**“ sa uvádza hodnota len pre nasledovné druhy miery rizika „NET_DV01“ a „NET_CS01“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
143. V dátovom poli 143 „**Hodnota miery rizika pre Vega expozíciu na aktuálne trhové úrovne**“ sa uvádza hodnota len pre druh miery rizika „VEGA_EXPO“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
144. V dátovom poli 144 „**Hodnota miery rizika pre Vega expozíciu na trhové úrovne o 10% nižšie**“ sa uvádza hodnota len pre druh miery rizika „VEGA_EXPO“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
145. V dátovom poli 145 „**Hodnota miery rizika pre Vega expozíciu na trhové úrovne o 10% vyššie**“ sa uvádza hodnota len pre druh miery rizika „VEGA_EXPO“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
146. V dátovom poli 146 „**Druh kódu metódy pre výpočet VAR**“ sa uvádza kód podľa číselníka
- „HISTO“ pre historickú simuláciu,
 - „CARLO“ pre simuláciu Monte Carlo,
 - „PARAM“ pre parametrickú metódu.
- Vypĺňa sa len pre druh miery rizika „VAR“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
147. V dátovom poli 147 „**Popis miery rizika**“ sa vyplňa voľný text. Vypĺňa sa povinne len, ak sa pre ľubovoľnú mieru rizika uvedie hodnota „0“ (vysvetlia sa dôvody tejto hodnoty). V ostatných prípadoch je to nepovinný údaj.
148. V dátovom poli 148 „**Na regulovanej burze cenných papierov**“ sa uvádza odhad trhovej hodnoty cenných papierov, s ktorými sa obchoduje na regulovaných trhoch. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 148 a 149 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
149. V dátovom poli 149 „**OTC**“ sa uvádza odhad trhovej hodnoty cenných papierov, s ktorými sa obchoduje na OTC trhoch. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 148 a 149 sa rovná 100%. Nepovinný údaj.
150. V dátovom poli 150 „**Na regulovanej burze cenných papierov**“ sa uvádza odhad objemu obchodov s derivátmi, s ktorými sa obchoduje na regulovaných trhoch. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 150 a 151 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.

151. V dátovom poli 151 „**OTC**“ sa uvádza odhad objemu obchodov s derivátmi, s ktorými sa obchoduje na OTC trhoch. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 150 a 151 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
152. V dátovom poli 152 „**Prostredníctvom CCP**“ sa uvádza odhad objemu obchodov derivátových transakcií zúčtovaných prostredníctvom centrálnej zúčtovacej protistrany. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 152 a 153 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
153. V dátovom poli 153 „**Dvojstranne**“ sa uvádza odhad objemu obchodov derivátových transakcií zúčtovaných dvojstranne. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt v dátových poliach 152 a 153 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
154. V dátovom poli 154 „**Prostredníctvom CCP**“ sa uvádza odhad trhovej hodnoty repo obchodov zúčtovaných prostredníctvom centrálnej zúčtovacej protistrany. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt dátových polí 154, 155 a 156 sa rovná 100 %. Ak správca AIF uvádza informácie o repo obchodoch, je potrebné do nich zahrnúť aj informácie o reverzných repo transakciách. Nepovinný údaj.
155. V dátovom poli 155 „**Dvojstranne**“ sa uvádza odhad trhovej hodnoty repo obchodov zúčtovaných dvojstranne. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt dátových polí 154, 155 a 156 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
156. V dátovom poli 156 „**Trojstranne**“ sa uvádza odhad trhovej hodnoty repo obchodov zúčtovaných trojstranne. Hodnota sa uvádza v percentách. Súčet hodnôt dátových polí 154, 155 a 156 sa rovná 100 %. Nepovinný údaj.
157. V dátovom poli 157 „**Hodnota kolaterálu zloženého vo forme hotovosti a peňažných ekvivalentov**“ sa uvádza hodnota kolaterálu vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Vykazuje sa trhovú hodnotu kolaterálu k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Zahŕňajú sa všetky kolaterály voči protistranám vrátane zabezpečovacích aktív predaných a zaručených v súvislosti s repo obchodmi a so zábezpekami predloženými v rámci dojednania, v súlade s ktorými si zaistená strana požičala cenné papiere. Repo obchody a reverzné repo obchody s rovnakou protistranou sa môžu zlúčiť tak, že budú zabezpečené rovnakým typom zábezpeky. Nepovinný údaj.
158. V dátovom poli 158 „**Hodnota kolaterálu zloženého vo forme iných cenných papierov (okrem hotovosti a peňažných ekvivalentov)**“ sa uvádza hodnota kolaterálu vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
159. V dátovom poli 159 „**Hodnota iného zloženého kolaterálu a kreditnej podpory (vrátane nominálnej sumy na akreditívoch a podobnej kreditnej podpory tretej**

strany)“ sa uvádza hodnota kolaterálu a kreditnej podpory vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

160.V dátovom poli 160 „**Poradie**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „1“ pre expozíciu voči prvej protistrane,
- b) „2“ pre expozíciu voči druhej protistrane,
- c) „3“ pre expozíciu voči tretej protistrane,
- d) „4“ pre expozíciu voči štvrtej protistrane,
- e) „5“ pre expozíciu voči piatej protistrane.

Správca AIF uvádza ľubovoľný typ expozície voči protistrane, bez akejkoľvek záruky predloženej na zníženie rizika protistrany. Riziko protistrany sa chápe ako trhové riziko. Ak sú protistrany súčasťou rovnakej skupiny, zlúčia sa na úrovni skupiny a nevystupujú ako samostatné subjekty. Povinný údaj.

161.V dátovom poli 161 „**Expozícia protistrany**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „true“ (áno), ak AIF má expozíciu voči protistrane (okrem centrálnej protistrany) zodpovedajúcu vykázananej triede,
- b) „false“ (nie) pre ostatné prípady.

Povinný údaj.

162.V dátovom poli 162 „**Názov protistrany**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Vypĺňa sa povinne pre každú protistranu len, ak sa v dátovom poli 161 „Expozícia protistrany“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

163.V dátovom poli 163 „**LEI kód protistrany**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 162 „Názov protistrany“ neuvedie názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

164.V dátovom poli 164 „**BIC kód protistrany**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 162 „Názov protistrany“ neuvedie názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

165.V dátovom poli 165 „**Percentuálny podiel čistej hodnoty aktív z celkovej hodnoty expozície protistrany**“ sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) zodpovedajúci celkovej expozícii pre každú z piatich najväčších expozícií protistrany, voči ktorej má AIF najväčšiu expozíciu. V rámci každého poradia sa vypĺňa povinne len, ak sa v dátovom poli 161 „Expozícia protistrany,“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

166.V dátovom poli 166 „**Poradie**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „1“ pre expozíciu prvej protistrany voči AIF,
- b) „2“ pre expozíciu druhej protistrany voči AIF,
- c) „3“ pre expozíciu tretej protistrany voči AIF,
- d) „4“ pre expozíciu štvrtej protistrany voči AIF,

e) „5“ pre expozíciu piatej protistrany voči AIF.
Povinný údaj.

167.V dátovom poli 167 „**Expozícia protistrany**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „true“ (áno), ak protistrana (okrem centrálnej zúčtovacej protistrany) zodpovedajúca vykázananej triede má expozíciu voči AIF,
- b) „false“ (nie) pre ostatné prípady.

Povinný údaj.

168.V dátovom poli 168 „**Názov protistrany**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. V rámci každého poradia sa vyplňa povinne len, ak sa v dátovom poli 167 „Expozícia protistrany“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

169.V dátovom poli 169 „**LEI kód protistrany**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 168 „Názov protistrany“ neuvedie názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

170.V dátovom poli 170 „**BIC kód protistrany**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 168 „Názov protistrany“ neuvedie názov subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

171.V dátovom poli 171 „**Percentuálny podiel čistej hodnoty aktív z celkovej hodnoty expozície protistrany**“ sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) zodpovedajúci celkovej expozícii pre každú z piatich najväčších expozícií protistrany, ktorá má najväčšiu expozíciu voči AIF. V rámci každého poradia sa vyplňa povinne len, ak sa v dátovom poli 167 „Expozícia protistrany,“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

172.V dátovom poli 172 „**Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP ?**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „true“ (áno), ak sa vykonalo priame zúčtovanie prostredníctvom CCP počas vykazovaného obdobia,
- b) „false“ (nie), ak nebolo vykonané priame zúčtovanie prostredníctvom CCP.

Táto otázka sa rozumie ako krytie správcov AIF, ktorí majú účet u zúčtovacích členov. Povinný údaj.

173.V dátovom poli 173 „**Poradie**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „1“ pre expozíciu prvej CCP,
- b) „2“ pre expozíciu druhej CCP,
- c) „3“ pre expozíciu tretej CCP.

Ak sa v dátovom poli 172 „Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?“ uvedie kód „true“, vyplňa sa povinne aspoň kód „1“. Uvádzajú sa tri CCP, v ktorých má AIF najväčšie čisté úverové expozície. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

- 174.V dátovom poli 174 „**Názov CCP**“ sa uvádza názov centrálnej zúčtovacej protistrany zodpovedajúci pridelenému LEI kódu alebo, ak nie je dostupný, BIC kódu, ak existuje. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 172 „Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?“ uvedie kód „true“ a v dátovom poli 173 „Poradie“ kód „1“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
- 175.V dátovom poli 175 „**LEI kód CCP**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, IEI kód. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 172 „Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
- 176.V dátovom poli 176 „**BIC kód CCP**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 172 „Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
- 177.V dátovom poli 177 „**Hodnota expozície CCP**“ sa uvádza hodnota expozície pre každú z troch najväčších expozícií CCP vyjadrená v základnej mene, bez desatinných miest. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 172 „Zúčtoval AIF počas vykazovaného obdobia nejaké transakcie priamo cez CCP?“ uvedie kód „true“ a v dátovom poli 173 „Poradie“ kód „1“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
- 178.V dátovom poli 178 „**1 deň alebo menej**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu jeden deň alebo menej. Každá investícia má priradenú iba jednu lehotu, ktorá predstavuje čo najkratšie obdobie, počas ktorého je možné investíciu primerane zlikvidovať alebo jej hodnotu priblížiť zostatkovej hodnote. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.
- 179.V dátovom poli 179 „**2 – 7 dní**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu dva až sedem dní. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.
- 180.V dátovom poli 180 „**8 – 30 dní**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu 8 až 30 dní. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.
- 181.V dátovom poli 181 „**31 – 90 dní**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu 31 až 90 dní. Celková suma

percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

182.V dátovom poli 182 „**91 – 180 dní**“ uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu 91 až 180 dní. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

183.V dátovom poli 183 „**181 – 365 dní**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu 181 až 365 dní. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

184.V dátovom poli 184 „**viac ako 365 dní**“ sa uvádza percentuálny podiel portfólia fondu, u ktorého je čas nevyhnutný na likvidáciu viac ako 365 dní. Celková suma percentuálnych podielov portfólia fondu vymedzených príslušnou likvidačnou lehotou sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

185.V dátovom poli 185 „**Hodnota nezaťažených peňažných prostriedkov**“ sa uvádza hodnota v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

186.V dátovom poli 186 „**1 deň alebo menej**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na jeden deň alebo menej, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Predpokladá sa, že aj keď sa vykonajú určité obmedzenia, na ktoré má správca AIF právomoc, výbery/vyplatenie sa nepozastavia a neexistuje ani poplatok za vyplatenie. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

187.V dátovom poli 187 „**2 – 7 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na dva až sedem dní, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

188.V dátovom poli 188 „**8 – 30 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na 8 až 30 dní, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma

percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

189.V dátovom poli 189 „**31 – 90 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na 31 až 90 dní, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

190.V dátovom poli 190 „**91 – 180 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na 91 až 180 dní, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

191.V dátovom poli 191 „**181 – 365 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na 181 až 365 dní v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

192.V dátovom poli 192 „**viac ako 365 dní**“ sa uvádza rozdelenie čistej hodnoty aktív (NAV) na časť pripadajúcu na viac ako 365 dní, v závislosti od najkratšej lehoty, v rámci ktorej môže investor investované prostriedky vybrať alebo môže prijať prostriedky zo spätného odkúpenia. Vypĺňa sa v percentuálnom vyjadrení. Celková suma percentuálnych podielov sa rovná 100 %. Vypĺňa sa, ak je vykázaná aspoň jedna položka profilu likvidity portfólia.

193.V dátovom poli 193 „**Poskytuje AIF investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie v rámci bežného postupu?**“ sa uvádza kód podľa číselníka
a) „true“ (áno), ak AIF poskytuje investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie (spätný odkup) v rámci bežného postupu,
b) „false“ (nie) v ostatných prípadoch.
Nepovinný údaj.

194.V dátovom poli 194 „**Aká je frekvencia vyplatení investorov?**“ sa uvádza kód podľa číselníka
a) „D“ pre dennú,
b) „W“ pre týždennú,
c) „F“ pre dvojtýždennú,
d) „M“ pre mesačnú
e) „Q“ pre štvrťročnú,

- f) „H“ pre polročnú,
- g) „A“ pre ročnú,
- h) „O“ pre inú,
- i) „N“ pre žiadnu (uvádza sa, ak AIF neponúkne investorom možnosť vyplatenia).

Ak existuje viacero tried akcií alebo podielových listov, údaje sa vykazujú za najväčšiu triedu akcií podľa čistej hodnoty aktív (NAV). Kód sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 6 prílohy č. II usmernenia ESMA. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 193 „Poskytuje AIF investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie v rámci bežného postupu?“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

195. V dátovom poli 195 **“Aká je výpovedná lehota požadovaná investormi na vyplatenie v dňoch?”** sa uvádza výpovedná lehota požadovaná investormi na vyplatenie (spätný odkup) v dňoch. Ak existuje viacero tried akcií alebo podielových listov, vyказuje sa výpovedná lehota vážená aktívami, pričom sa vypĺňa počet dní bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 193 „Poskytuje AIF investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie v rámci bežného postupu?“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

196. V dátovom poli 196 **„Aká je lehota, počas ktorej je pozastavené vyplácanie a predávanie cenných papierov investorom („lock-up“ period) v dňoch?“** sa uvádza doba, počas ktorej je pozastavené vyplácanie a predávanie cenných papierov investorom (lock-up period). Vypĺňa sa v dňoch. Ak existuje viacero tried akcií alebo podielových listov, vyказuje sa lehota na pozastavenie vážená aktívami, pričom sa vypĺňa počet dní bez desatinných miest. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 193 „Poskytuje AIF investorom právo na stiahnutie ponuky/vyplatenie v rámci bežného postupu?“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

197. V dátovom poli 197 **„Odkladanie do bočných vreciek (v %)”** sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) AIF, ktoré ku dňu vypracovania výkazu podliehajú opatreniu „odkladanie do bočných vreciek“. Nepovinný údaj.

198. V dátovom poli 198 **„Obmedzenie vyplácania (v %)”** sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) AIF, ktoré ku dňu vypracovania výkazu podliehajú opatreniu „obmedzenie vyplácania“. Nepovinný údaj.

199. V dátovom poli 199 **„Pozastavenie obchodovania (v %)”** sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) AIF, ktoré ku dňu vypracovania výkazu podliehajú opatreniu „pozastavenie obchodovania“. Nepovinný údaj.

200. V dátovom poli 200 **„Iné typy opatrení“** sa vypĺňa voľný text na popis iných typov opatrení na spravovanie nelikvidných aktív. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 201 „Iné opatrenia na správu nelikvidných aktív (v %)” uvedie údaj. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

201. V dátovom poli 201 „**Iné opatrenia na správu nelikvidných aktív (v %)**“ sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) AIF, ktoré ku dňu vypracovania výkazu podliehajú inému opatreniu na spravovanie nelikvidných aktív uvedených v dátovom poli 200 „Iné typy opatrení“. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 200 „Iné typy opatrení“ uvedie informácia. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
202. V dátovom poli 202 „**Osobitný režim ako % z čistej hodnoty aktív**“ sa uvádza percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) AIF, ktoré ku dňu vypracovania výkazu podliehajú osobitnému režimu vyplývajúcemu z ich nelikvidnej povahy v súlade s § 159a ods. 4 zákona (čl. 23 ods. 4 AIFMD). Nepovinný údaj.
203. V dátovom poli 203 „**Existujú investori, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie alebo právo na prednostné zaobchádzanie (napríklad prostredníctvom sprievodného listu), a preto je potrebné o nich informovať investorov AIF v súlade s § 159a ods. 1 písm. j) zákona (čl. 23 ods. 1 písm. j) AIFMD)?**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či existujú investori, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie alebo právo na prednostné zaobchádzanie. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno),
 - b) „false“ (nie).
- Nepovinný údaj.
204. V dátovom poli 204 „**Týkajúce sa odlišného poskytovania informácií / podávania správ investorom**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či existuje rozdiel vo zverejňovaní/poskytovaní informácií pre investorov, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno),
 - b) „false“ (nie).
- Nepovinný údaj.
205. V dátovom poli 205 „**Týkajúce sa odlišných podmienok likvidity investorov**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či existuje rozdiel v podmienkach likvidity investorov, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno),
 - b) „false“ (nie).
- Nepovinný údaj.
206. V dátovom poli 206 „**Týkajúce sa odlišných podmienok poplatkov pre investorov**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či existuje rozdiel v podmienkach poplatkov pre investorov, ktorým sa poskytuje prednostné zaobchádzanie. Vypĺňa sa kód podľa číselníka
- a) „true“ (áno),
 - b) „false“ (nie).
- Nepovinný údaj.

207.V dátovom poli 207 „**Iné prednostné zaobchádzanie ako sa uvádza vyššie**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či existuje iná forma prednostného zaobchádzania s investormi. Vypĺňa sa kód podľa číselníka

- a) „true“ (áno),
 - b) „false“ (nie).
- Nepovinný údaj.

208.V dátovom poli 208 „**Typ skupiny investorov**“ sa uvádza rozdelenie vlastníctva podielových listov v AIF podľa nominálneho vlastníctva jednotlivých skupín investorov (ako percentuálny podiel čistej hodnoty aktív (NAV) na majetku AIF). Vypĺňa sa kód podľa číselníka

- a) „NFCO“ pre nefinančné korporácie (Non-financial corporations),
- b) „BANK“ pre banky (Banks),
- c) „INSC“ pre poisťovacie korporácie (Insurance corporations),
- d) „OFIN“ pre iné finančné inštitúcie (Other financial institutions),
- e) „PFND“ pre penzijné fondy / fondy (Pension plans / funds),
- f) „GENG“ pre verejnú správu (General government),
- g) „OCIU“ pre iné podniky kolektívneho investovania (Other collective investment undertakings) (napríklad fondy fondov alebo hlavné fondy),
- h) „HHL D“ pre domácnosti (Households),
- i) „UNKN“ pre neznáme skupiny investorov (Unknown),
- j) „NONE“ ak neexistuje žiadna skupina investorov (None).

Kód sa vyberá zo zoznamu kódov uvedených v tabuľke č. 7 prílohy č. II usmernenia ESMA. Povinný údaj.

209.V dátovom poli 209 „**Podiel skupiny investorov na čistej hodnote aktív**“ sa uvádza percentuálny podiel na čistej hodnote aktív (NAV) pre každý typ skupiny investorov. Povinný údaj.

210.V dátovom poli 210 „**Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF**“ sa uvádza výška pôžičky pre AIF a hotovostného financovania (vrátane všetkých čerpaných a nečerpaných, viazaných a neviazaných úverových liniek, ako aj akéhokoľvek termínovaného financovania). Vypĺňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

211.V dátovom poli 211 „**1 deň alebo menej**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu jeden deň a menej, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

212. V dátovom poli 212 „**2 – 7 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu dva až sedem dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
213. V dátovom poli 213 „**8 – 30 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu 8 až 30 dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
214. V dátovom poli 214 „**31 – 90 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu 31 až 90 dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
215. V dátovom poli 215 „**91 – 180 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu 91 až 180 dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
216. V dátovom poli 216 „**181 – 365 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu 181 až 365 dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.
217. V dátovom poli 217 „**viac ako 365 dní**“ sa uvádza rozdelenie celkovej finančnej sumy uvedenej v dátovom poli 210 „Uvádza sa súhrnná výška pôžičiek pre AIF a hotovostného financovania dostupného pre AIF“ medzi lehotu viac ako 365 dní, v závislosti od najdlhšej lehoty, počas ktorej je veriteľ zmluvne viazaný poskytovať

takéto financovanie. Suma podielov všetkých lehôt sa rovná 100 %. Vypĺňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 210 uvedie údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

218.V dátovom poli 218 „**Celkový počet otvorených pozícií**“ sa uvádza celkový počet otvorených pozícií. Správca AIF vypočítava úroveň pozície (a nie úroveň emitenta) nakoľko táto otázka má prevádzkové zameranie. Výpočet sa uskutočňuje k poslednému pracovnému dňu vykazovaného obdobia. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

219.V dátovom poli 219 „**Január**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac január. Vypĺňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre AIF s viacerými triedami akcií sa údaj uvádza na úrovni AIF, a nie na úrovni každej triedy akcií. Nepovinný údaj.

Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac január sa vykazuje len raz.

Pre prvý štvrťrok kalendárneho roka (Q1) sa vykazujú len údaje za mesiace január, február, marec.

Pre druhý štvrťrok kalendárneho roka (Q2) sa vykazujú len údaje za mesiace apríl, máj, jún.

Pre tretí štvrťrok kalendárneho roka (Q3) sa vykazujú len údaje za mesiace júl, august, september.

Pre štvrtý štvrťrok kalendárneho roka (Q4) sa vykazujú len údaje za mesiace október, november, december.

Pre prvý polrok kalendárneho roka (H1) sa vykazujú len údaje za mesiace január, február, marec, apríl, máj, jún.

Pre druhý polrok kalendárneho roka (H2) sa vykazujú len údaje za mesiace júl, august, september, október, november, december.

Pre kalendárny rok (Y1) sa vykazujú údaje za všetky mesiace v roku.

Pre špecifické obdobie prvý až tretí štvrťrok (X1) sa vykazujú len údaje za mesiace január, február, marec, apríl, máj, jún, júl, august, september.

Pre špecifické obdobie druhý až štvrtý štvrťrok (X2) sa vykazujú len údaje za mesiace apríl, máj, jún, júl, august, september, október, november, december.

220.V dátovom poli 220 „**Február**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac február. Vypĺňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac február sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.

221.V dátovom poli 221 „**Marec**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac marec. Vypĺňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac marec sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.

222.V dátovom poli 222 „**Apríl**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac apríl. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac apríl sa vykazuje len raz. Vypĺňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

223. V dátovom poli 223 „**Máj**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac máj. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac máj sa vykazuje len raz. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.
224. V dátovom poli 224 „**Jún**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac jún. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac jún sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
225. V dátovom poli 225 „**Júl**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac júl. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac júl sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
226. V dátovom poli 226 „**August**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac august. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac august sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
227. V dátovom poli 227 „**September**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac september. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac september sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
228. V dátovom poli 228 „**Október**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac október. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac október sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
229. V dátovom poli 229 „**November**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac november. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac november sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
230. V dátovom poli 230 „**December**“ sa uvádzajú hrubé výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac december. Vyplňa sa v percentách, pred odpočítaním poplatkov za správu a výkonnosť. Pre každý kalendárny rok, údaj za mesiac december sa vykazuje len raz. Nepovinný údaj.
231. V dátovom poli 231 „**Január**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac január. Vyplňa sa v percentách, po

odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Pre AIF s viacerými triedami akcií sa údaj uvádza na úrovni AIF, a nie na úrovni každej triedy akcií. Nepovinný údaj.

232.V dátovom poli 232 „**Február**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac február. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

233.V dátovom poli 233 „**Marec**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac marec. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

234.V dátovom poli 234 „**Apríl**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac apríl. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

235.V dátovom poli 235 „**Máj**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac máj. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

236.V dátovom poli 236 „**Jún**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac jún. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

237.V dátovom poli 237 „**Júl**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac júl. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

238.V dátovom poli 238 „**August**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac august. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

239.V dátovom poli 239 „**September**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac september. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

240.V dátovom poli 240 „**Október**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac október. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

241.V dátovom poli 241 „**November**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac november. Vyplňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.

- 242.V dátovom poli 242 „**December**“ sa uvádzajú čisté výnosy z investícií alebo vnútorné výnosové percento (IRR) AIF za mesiac december. Vypĺňa sa v percentách, po odpočítaní poplatkov za správu a výkonnosť. Nepovinný údaj.
- 243.V dátovom poli 243 „**Január**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi december a január vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Výpočet sa uvádza bez poplatku. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 244.V dátovom poli 244 „**Február**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi január a február vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 245.V dátovom poli 245 „**Marec**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi február a marec vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 246.V dátovom poli 246 „**Apríl**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi marec a apríl vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 247.V dátovom poli 247 „**Máj**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi apríl a máj vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 248.V dátovom poli 248 „**Jún**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi máj a jún vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 249.V dátovom poli 249 „**Júl**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi jún a júl vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 250.V dátovom poli 250 „**August**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi júl a august vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 251.V dátovom poli 251 „**September**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi august a september vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
- 252.V dátovom poli 252 „**Október**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi september a október vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.

253. V dátovom poli 253 „**November**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi október a november vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
254. V dátovom poli 254 „**December**“ sa uvádza zmena čistej hodnoty aktív (NAV) medzi mesiacmi november a december vrátane vplyvu upísaní a vyplatení. Vypĺňa sa v percentách. Nepovinný údaj.
255. V dátovom poli 255 „**Január**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca január. Uvádza sa skutočne zaplatená suma investorom za každý mesiac vykazovaného obdobia, a nie prisľúbený kapitál. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
256. V dátovom poli 256 „**Február**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca február. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
257. V dátovom poli 257 „**Marec**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca marec. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
258. V dátovom poli 258 „**Apríl**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca apríl. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
259. V dátovom poli 259 „**Máj**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca máj. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
260. V dátovom poli 260 „**Jún**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca jún. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
261. V dátovom poli 261 „**Júl**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca júl. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
262. V dátovom poli 262 „**August**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca august. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
263. V dátovom poli 263 „**September**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca september. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
264. V dátovom poli 264 „**Október**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca október. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
265. V dátovom poli 265 „**November**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca november. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
266. V dátovom poli 266 „**December**“ sa uvádza počet upísaní v priebehu mesiaca december. Vypĺňa sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

- 267.V dátovom poli 267 „**Január**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca január. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 268.V dátovom poli 268 „**Február**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca február. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 269.V dátovom poli 269 „**Marec**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca marec. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 270.V dátovom poli 270 „**Apríl**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca apríl. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 271.V dátovom poli 271 „**Máj**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca máj. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 272.V dátovom poli 272 „**Jún**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca jún. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 273.V dátovom poli 273 „**Júl**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca júl. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 274.V dátovom poli 274 „**August**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca august. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 275.V dátovom poli 275 „**September**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca september. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 276.V dátovom poli 276 „**Október**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca október. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 277.V dátovom poli 277 „**November**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca november. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 278.V dátovom poli 278 „**December**“ sa uvádza počet vyplatení v priebehu mesiaca december. Vyplní sa bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
- 279.V dátovom poli 279 „**Uvádzajú sa výsledky stresových testov vykonaných podľa § 37a ods. 4 písm. b) zákona (čl. 15 ods. 3 písm. b) AIFMD)**“ sa vyplní voľný text týkajúci sa výsledkov stresových testov vykonaných podľa § 37a ods. 4 písm. b) zákona (čl. 15 ods. 3 písm. b) AIFMD) (riziká spojené s každou investičnou pozíciou AIF a ich celkový vplyv na portfólio AIF možno riadne identifikovať, merať, riadiť a priebežne monitorovať aj prostredníctvom použitia primeraných postupov stresového testovania). Povinný údaj.

280. V dátovom poli 280 „**Uvádzajú sa výsledky stresových testov vykonaných podľa § 37b ods. 2 zákona (čl. 16 ods. 1 druhý pododsek AIFMD)**“ sa vyplňa voľný text týkajúci sa výsledkov stresových testov vykonaných podľa § 37b ods. 2 zákona (čl. 16 ods. 1 druhý pododsek AIFMD) (správca AIF pravidelne vykonáva stresové testy za bežných a výnimočných podmienok likvidity, ktoré mu umožňujú vyhodnotiť riziko likvidity AIF a zodpovedajúcim spôsobom monitorovať riziko likvidity AIF). Povinný údaj.
281. V dátovom poli 281 „**Opakovaná účelová viazanosť**“ sa uvádza indikátor, ktorý vyjadruje, či kontrakt medzi správcom AIF a protistranou umožňuje protistrane opakovane účelovo viazať kolaterál pre príslušný AIF. Vyplňa sa kód podľa číselníka
- „true“ (áno), ak kontrakt umožňuje znovu účelovo viazať kolaterál,
 - „false“ (nie) v ostatných prípadoch.
- Povinný údaj.
282. V dátovom poli 282 „**Zo sumy kolaterálu a inej kreditnej podpory, ktorú vykazujúci AIF zložil pre protistrany: aký percentuálny podiel bol znovu účelovo viazaný protistranami?**“ sa uvádza percentuálny podiel kolaterálu a inej kreditnej podpory (ktorú vykazujúci AIF zložil pre protistrany), ktorý bol znovu účelovo viazaný protistranami. Vyplňa sa v percentách. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 281 „Opakovaná účelová viazanosť“ uvedie kód „false“. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.
283. V dátovom poli 283 „**Nezaistené prijaté hotovostné pôžičky**“ sa uvádza hodnota nezaistených prijatých hotovostných pôžičiek. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
284. V dátovom poli 284 „**Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom/zaistené prijaté hotovostné pôžičky – prostredníctvom primárneho brokera**“ sa uvádza hodnota prijatých hotovostných pôžičiek zabezpečených kolaterálom/zaistených prijatých hotovostných pôžičiek prostredníctvom primárneho brokera. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
285. V dátovom poli 285 „**Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom/zaistené prijaté hotovostné pôžičky – prostredníctvom (reverznej) repo transakcie**“ sa uvádza hodnota prijatých hotovostných pôžičiek zabezpečených kolaterálom/zaistených prijatých hotovostných pôžičiek prostredníctvom reverznej repo transakcie. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.
286. V dátovom poli 286 „**Prijaté hotovostné pôžičky zabezpečené kolaterálom/zaistené prijaté hotovostné pôžičky – inak**“ sa uvádza hodnota prijatých hotovostných pôžičiek zabezpečených kolaterálom/zaistených prijatých

hotovostných pôžičiek iným spôsobom. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

287.V dátovom poli 287 „**Deriváty obchodované na burze: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža**“ sa uvádza hodnota prijatej pôžičky vlozenej do finančných nástrojov prostredníctvom derivátov obchodovaných na burze (hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža). Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

288.V dátovom poli 288 „**OTC deriváty: hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža**“ sa uvádza hodnota prijatej pôžičky vlozenej do finančných nástrojov prostredníctvom OTC derivátov (hrubá expozícia mínus zaznamenaná marža). Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

289.V dátovom poli 289 „**Hodnota cenných papierov v rámci prijatej pôžičky na krátke pozície**“ sa uvádza hodnota cenných papierov v rámci prijatej pôžičky na krátke pozície. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Nepovinný údaj.

290.V dátovom poli 290 „**Názov kontrolovanej štruktúry**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu. Ak LEI kód nie je dostupný, uvádza sa názov zodpovedajúci BIC kódu, ak existuje. Nepovinný údaj.

291.V dátovom poli 291 „**LEI kód kontrolovanej štruktúry**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, uvádza sa IEI kód. Nepovinný údaj.

292.V dátovom poli 292 „**BIC kód kontrolovanej štruktúry**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nepovinný údaj.

293.V dátovom poli 293 „**Hodnota expozície kontrolovanej štruktúry**“ sa uvádza hrubá expozícia finančných a/alebo právnych štruktúr kontrolovaných AIF podľa vymedzenia v recitáli 78 AIFMD. Vyplňa sa v základnej mene, bez desatinných miest. Vyplňa sa povinne len, ak sa v dátovom poli 290 „Názov kontrolovanej štruktúry“ uvedie názov príslušného subjektu. Nepovinný údaj pre ostatné prípady.

294.V dátovom poli 294 „**a) vypočítaný podľa Hrubej metódy**“ sa uvádza hodnota pákového efektu AIF vypočítaná podľa Hrubej metódy. Vyplňa sa ako percentuálny podiel z čistej hodnoty aktív (NAV). Povinný údaj.

295.V dátovom poli 295 „**b) vypočítaný podľa Záväzkovej metódy**“ sa uvádza hodnota pákového efektu AIF vypočítaná podľa Záväzkovej metódy. Vyplňa sa ako percentuálny podiel z čistej hodnoty aktív (NAV). Povinný údaj.

296.V dátovom poli 296 „**Poradie**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „1“ pre prvý najväčší zdroj,
 - b) „2“ pre druhý najväčší zdroj,
 - c) „3“ pre tretí najväčší zdroj,
 - d) „4“ pre štvrtý najväčší zdroj,
 - e) „5“ pre piaty najväčší zdroj.
- Povinný údaj.

297.V dátovom poli 297 „**Zdroj výpožičky**“ sa uvádza kód podľa číselníka

- a) „true“ (áno), ak AIF má jeden zdroj prijatých hotovostných pôžičiek alebo prijatých pôžičiek cenných papierov pre vykazované poradie,
 - b) „false“ (nie) v ostatných prípadoch.
- Povinný údaj.

298.V dátovom poli 298 „**Názov zdroja**“ sa uvádza názov subjektu v úplnom znení zodpovedajúci pridelenému LEI kódu. Ak LEI kód nie je dostupný, uvádza sa názov zodpovedajúci BIC kódu, ak existuje. Vypĺňa sa povinne v rámci každého poradia len, ak sa v dátovom poli 297 „Zdroj výpožičky“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

299.V dátovom poli 299 „**LEI kód zdroja**“ sa uvádza LEI kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 17442 alebo, ak nie je dostupný, uvádza sa IEI kód. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 297 „Zdroj výpožičky“ uvedie kód „false“.

300.V dátovom poli 300 „**BIC kód zdroja**“ sa uvádza BIC kód subjektu podľa medzinárodnej normy ISO 9362. Nevypĺňa sa, ak sa v dátovom poli 297 „Zdroj výpožičky“ uvedie kód „false“.

301.V dátovom poli 301 „**Suma prijatá v súvislosti s pákovým efektom**“ sa uvádza suma prijatá v súvislosti s pákovým efektom od každého z piatich najväčších zdrojov prijatých hotovostných pôžičiek alebo prijatých pôžičiek cenných papierov. Vykazuje sa v základnej mene, bez desatinných miest. Vypĺňa sa povinne v rámci každého poradia len, ak sa v dátovom poli 297 „Zdroj výpožičky“ uvedie kód „true“. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

302.V dátovom poli 302 „**Hodnota VAR**“ sa uvádza hodnota len pre druh miery rizika „VAR“. Nepovinný údaj. Nevypĺňa sa v ostatných prípadoch.

303.Použité skratky

Skratka	Anglický názov	Slovenský názov
AIF	Alternative Investment Fund	Alternatívny investičný fond
AIFM	Alternative Investment Fund Managers	Správca alternatívneho investičného fondu
AIFMD	Directive on Alternative Investment Fund Managers	Smernica o správcoch alternatívnych investičných fondov
AII	Alternative Instrument Identifier	Alternatívny identifikátor

		nástroja
AUM	Assets Under Management	Celková hodnota spravovaných aktív
BIC	Bank Identifier Code	Identifikačný kód banky
CCP	Central clearing counterparty	Centrálne zúčtovacia protistrana
CUSIP	Committee on Uniform Securities Identification Procedures	Výbor pre jednotné postupy na identifikáciu cenných papierov
ECB	European Central Bank	Európska centrálna banka
ESMA	European Securities and Markets Authority	Európsky orgán pre cenné papiere a trhy
EÚ	European Union	Európska únia
HFT	High Frequency Trading	Automatizované algoritmické obchodovanie
IEI	Interim Entity Identifier	Dočasný identifikátor právnickej osoby
ISIN	International Securities Identification Number	Medzinárodné identifikačné číslo cenného papiera
ISO	International Organization for Standardization	Medzinárodná organizácia pre normalizáciu
ISO 3166-1	Codes for the representation of names of countries and their subdivisions – part 1: Country codes	
ISO 4217	Codes for the representation of currencies and funds	
ISO 6166	Securities and related financial instruments – International securities identification numbering system (ISIN)	
ISO 8601	Data elements and interchange formats – Information interchange – Representation of dates and times	
ISO 9362	Banking – Bankig telecommunication messages – Business identifier code (BIC)	
ISO 10383	Securities and related financial instruments – Codes for exchanges and market identification (MIC)	
ISO 17442	Financial services – Legal Entity Identifier (LEI)	
LEI	Legal Entity Identifier	Identifikátor právnickej osoby
MIC	Codes for exchanges and market identification	Identifikačný kód trhu
MiFID	The markets in Financial Instruments Directive	Smernica o trhoch s finančnými nástrojmi
NAV	Net Asset Value	Čistá hodnota aktív
OTC	Over the counter	Mimoburzový trh
RIC	Reuters Identifier Code	Identifikačný kód Reuters
SEDOL	Stock Exchange Daily Official List	Denný oficiálny burzový

		zoznam
SWIFT	Society for Worldwide Interbank Financial Telecommunication	Spoločnosť pre celosvetovú medzibankovú finančnú telekomunikáciu
TARGET	Trans-European Automated Real-time Gross settlement Express Transfer system	Trans-európsky automatizovaný systém hrubého zúčtovania expresných transferov v reálnom čase
Usmernenie ESMA	Guidelines on reporting obligations under Articles 3(3)(d) and 24 (1), (2) and (4) of the AIFMD	Usmernenia o ohlasovacej povinnosti podľa čl. 3 ods. 3 písm. d) a čl. 24 ods. 1, 2 a 4 smernice AIFMD
UTC	Coordinated Universal Time	Koordinovaný svetový čas
VaR	Value at Risk	Hodnota v riziku

304. Vymedzenie obsahu jednotlivých kategórií aktív na účely tohto výkazu

Hotovosť a peňažné ekvivalenty	Zahŕňa riziká tried aktív hotovosti a peňažných ekvivalentov, ako napríklad depozitné certifikáty, bankové akcepty a podobné nástroje, ktoré sa držia na investičné účely a neposkytujú vyššiu návratnosť ako 3-mesačný štátny dlhopis vysokej úrovne kvality.
Kótované akcie	Zahŕňa všetky fyzické expozície AIF voči cenným papierom kótovaným alebo obchodovaným na regulovanom trhu. Do tejto kategórie sa nezahŕňajú expozície získané synteticky alebo prostredníctvom derivátov (namiesto toho sa uvádzajú v kategórii „akciových derivátov“).
Nekótované akcie	Zahŕňa všetky fyzické expozície voči nekótovaným cenným papierom. Nekótované cenné papiere sa rozumejú tie, ktoré nie sú kótované, ani sa s nimi neobchoduje na regulovanom trhu. Do tejto kategórie sa nezahŕňajú expozície získané synteticky alebo prostredníctvom derivátov (namiesto toho sa uvádzajú v kategórii „akciových derivátov“).
Podnikové dlhopisy	Zahŕňa všetky fyzické expozície voči všetkým podnikovým dlhopisom, ktoré AIF drží. Do tejto kategórie sa nezahŕňajú expozície získané synteticky alebo prostredníctvom derivátov (namiesto toho sa uvádzajú v kategórii „derivátov s fixným príjmom“).
Štátne dlhopisy	Zahŕňa expozície voči všetkým štátnym dlhopisom, ktoré AIF drží. Na účely vykazovania sa štátnym dlhopisom rozumie dlhopis vydaný vládou štátu (vrátane centrálnych vlád, vládnych agentúr, iných vlád a centrálnych bánk), ktorý je vydaný v miestnej alebo zahraničnej mene. Zahŕňa aj akékoľvek nadnárodné obligácie z kategórie štátnych dlhopisov zo štátov mimo G10.

	Zahŕňa nadnárodné obligácie EÚ z kategórie „obligácie EÚ“ pre jednotlivé expozície a „obligácie členského štátu EÚ“ pre obrat.
Dlhopisy nečlenských štátov EÚ z G10	Zahŕňa expozície voči všetkým dlhopisom nečlenských štátov EÚ z G10.
Obligácie samospráv	Zahŕňa všetky expozície voči samosprávam, ktoré nie sú garantované vládou štátu.
Konvertovateľné dlhopisy	Zahŕňa expozície voči všetkým prevoditeľným zmenkám alebo dlhopisom (ktoré sa ešte nepreviedli do akcií alebo hotovosti), ktoré AIF drží.
Úvery s pákovým efektom	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých úverov s pákovým efektom, ktoré AIF drží. V praxi sú takéto pôžičky v podstate súčasťou finančnej štruktúry skupovania podielov na dlh a môžu predstavovať vyššie úverové riziko. Nezahŕňa žiadne pozície, ktoré sa držia prostredníctvom LDCS (swapy na úverové zlyhanie na dlh) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Ostatné úvery	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých ostatných úverov vrátane bilaterálnych alebo kartelových pôžičiek, faktoringových alebo forfeitingových financií a fakturačných zliav. Nezahŕňa žiadne pozície, ktoré sa držia prostredníctvom LDCS (swapy na úverové zlyhanie na dlh) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Štruktúrované produkty/cenné papiere – cenné papiere kryté aktívami	Zahŕňa nominálnu hodnotu akýchkoľvek investícií, ktoré drží AIF v štruktúrovaných produktoch v cenných papieroch krytých aktívami vrátane (ale bez obmedzenia) automobilových pôžičiek, pôžičiek na kreditné karty, spotrebiteľských pôžičiek, študentských pôžičiek, pôžičiek na vybavenie, CDO (hotovosť a syntetické) a celej obchodnej sekuritizácie. Nezahŕňa žiadne pozície držané v MBS, RMBS, CMBS a CDS – tieto sa uvádzajú v kategóriách „MBS, RMBS, CMBS“ a „CDS“.
Štruktúrované produkty/cenné papiere – MBS/RMBS/CMBS	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých investícií AIF do cenných papierov krytých hypotekárnym úverom emitovaných podnikmi sponzorovanými vládou (MBS), cenných papierov krytých hypotekárnym úverom na bytové nehnuteľnosti (RMBS) a cenných papierov krytých hypotekárnym úverom na obchodné nehnuteľnosti (CMBS). Nezahŕňa žiadne pozície držané prostredníctvom CDS (swapy na úverové zlyhanie) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Štruktúrované produkty/cenné papiere – krátke cenné papiere kryté	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých investícií AIF do obchodných papierov zaručených aktívami vrátane (ale bez obmedzenia) nástrojov štruktúrovaných investícií,

aktívami	programov sprostredkovateľských spoločností s jedným predajcom a viacerými predajcami. Nezahŕňa žiadne pozície držané prostredníctvom CDS (swapy na úverové zlyhanie) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Štruktúrované produkty/cenné papiere – CDO/CLO	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých investícií AIF v zaistených dlhových obligáciách (hotovostných a syntetických) alebo zaistených pôžičkových obligáciách. Nezahŕňa žiadne pozície držané prostredníctvom CDS (swapy na úverové zlyhanie) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Štruktúrované/sekuritizované produkty – iné	Zahŕňa nominálnu hodnotu všetkých investícií AIF do iných foriem štruktúrovaných investícií, ktoré nie sú pokryté v inej kategórii. Nezahŕňa žiadne pozície držané prostredníctvom CDS (swapy na úverové zlyhanie) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Kapitálové deriváty	Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči cenným papierom držaným synteticky alebo prostredníctvom derivátov. Meria expozíciu ako celkovú nominálnu hodnotu futures a nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta. Zahŕňa futures s cennými papiermi i jednoakciové deriváty. V tejto kategórii sa uvádzajú aj swapy dividend a opcie.
Deriváty s fixným príjmom	Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči fixnému príjmu držanému synteticky alebo prostredníctvom derivátov (celková nominálna hodnota futures). Nezahŕňa žiadne pozície držané cez CDS (swapy na úverové zlyhanie) – tieto sa uvádzajú v kategórii „CDS (swapov na úverové zlyhanie)“.
Deriváty swapov na úverové zlyhanie – CDS pod jedným názvom	Zahŕňa nominálnu hodnotu CDS refinancujúcich jeden subjekt. Dlhou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota pripísanej alebo predanej ochrany a krátkou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota ochrany kúpenej. Zahŕňa do výpočtu akékoľvek LCDS pod jedným názvom. Uvádza sa v členení úverovej ochrany pod jedným názvom na vládny, finančný sektor a iné subjekty.
Deriváty swapov na úverové zlyhanie – Index CDS	Zahŕňa nominálnu hodnotu CDS refinancujúcich štandardizovaný kôš kreditných subjektov, napríklad ukazovateľov CDX a iTraxx. Zahŕňa ukazovatele refinancovania úverov s pákovým efektom (napríklad iTraxx LevX Senior Index). Dlhou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota pripísanej alebo predanej ochrany a krátkou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota ochrany kúpenej.
Deriváty swapov na kreditné	Zahŕňa nominálnu hodnotu CDS refinancujúcich

<p>zlyhanie – exotické (vrátane tranží úverového zlyhania) CDS</p>	<p>rezervované koše alebo tranže CDO, CLO alebo iných štruktúrovaných nástrojov. Dlhou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota pripísanej alebo predanej ochrany a krátkou hodnotou sa rozumie nominálna hodnota ochrany kúpenej.</p>
<p>Komoditné deriváty – surová ropa</p>	<p>Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči surovej rope, či už držaných synteticky alebo cez deriváty (bez ohľadu na to, či sú deriváty vyrovnané fyzicky alebo hotovostne). Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures, nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta. Iné typy ropných a energetických produktov (okrem zemného plynu), ako napríklad etanol, vykurovací olej, propán a benzín sa zahŕňajú do kategórie „iné komodity“.</p>
<p>Komoditné deriváty – zemný plyn</p>	<p>Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči zemnému plynu, či už držaných synteticky alebo cez deriváty (bez ohľadu na to, či sú deriváty vyrovnané fyzicky alebo hotovostne). Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures, nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta. Iné typy ropných a energetických produktov (okrem zemného plynu), ako napríklad etanol, vykurovací olej, propán a benzín sa zahŕňajú do kategórie „iné komodity“.</p>
<p>Komoditné deriváty – zlato</p>	<p>Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči zlatu, či už držanému synteticky alebo cez deriváty (bez ohľadu na to, či sú deriváty vyrovnané fyzicky alebo hotovostne). Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures, nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta.</p>
<p>Komoditné deriváty – energia</p>	<p>Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči energii (všetky regióny), či už držanej synteticky, alebo cez deriváty (bez ohľadu na to, či sú deriváty vyrovnané fyzicky alebo hotovostne). Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures, nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta.</p>
<p>Komoditné deriváty – iné komodity</p>	<p>Zahŕňa hodnotu všetkých expozícií AIF voči iným komoditám (ktoré nie sú pokryté v uvedených kategóriách), či už držaných synteticky, alebo cez deriváty (bez ohľadu na to, či sú deriváty vyrovnané fyzicky alebo hotovostne). Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures, nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta.</p>
<p>Menové deriváty</p>	<p>Uvádza sa celková hrubá nominálna hodnota nesplatených kontraktov AIF. Počíta sa iba jedna menová strana všetkých transakcií. Zahŕňa iba menové deriváty na investičné účely (to znamená nie tie, ktoré slúžia na menové zaistenie rôznych tried akcií).</p>

Úrokové deriváty	Zahŕňa celkovú hrubú nominálnu hodnotu nesplatených kontraktov úrokových derivátov AIF. Zahŕňa celkovú nominálnu hodnotu futures a nominálnu hodnotu opcií upravenú o delta.
Ostatné deriváty	Uvádza sa celková hrubá nominálna hodnota nesplatených kontraktov AIF týkajúcich sa exotických derivátov (napríklad počasia alebo emisných derivátov) vrátane prechodných, variabilných a korelačných derivátov.
Nehnutelnosti/hmotné aktíva	Zahŕňa sa hodnota priamo držaných nehnuteľností. Nezahŕňa realitné expozície držané prostredníctvom kmeňových akcií spoločností, ako napríklad zapísané kmeňové akcie (alebo ich príslušné deriváty) alebo majetkové účasti nezapísaných realitných investičných trustov, ak sa realitná spoločnosť, pre ktorú sa drží kmeňová akcia, nevytvorila na expresný účel držania investície v oblasti nehnuteľností pre AIF a základné aktíva, a účelom spoločnosti je investovať do nehnuteľností a AIF má kontrolný podiel v tejto spoločnosti (inak zahŕňa expozíciu do „kótovaných cenných papierov“ alebo „nekótovaných cenných papierov“ podľa okolností). Vykazuje sa hodnota investície do nehnuteľnosti vykazovanej v najnovších finančných účtoch AIF alebo, ak nie sú k dispozícii, v reálnej hodnote. Na účely vykazovania sa nevypracúva nový odhad hodnoty nehnuteľnosti.
Komodity	Nezahŕňa expozície komodít aktuálne držaných cez deriváty, dokonca aj keď sa očakáva, že sa fyzicky vyrovnajú v budúcnosti. Zahŕňa komoditné expozície, ktoré sa pôvodne získali cez deriváty, pod podmienkou, že nie sú držané cez deriváty.
Investície do fondov	V tejto kategórii aktív sa pre fondy peňažného trhu a investície AIF na účely spravovania hotovosti uvádzajú všetky investície AIF do fondov peňažných trhov a fondov spravovania hotovosti. Uvádzajú sa v členení na tie, ktoré spravuje správcovská spoločnosť a tie, ktoré spravuje iná správcovská spoločnosť. V tejto kategórii aktív sa pre iné AIF uvádzajú všetky investície AIF do iných AIF (bez zahrnutia fondov peňažného trhu alebo spravovania hotovosti) vrátane (ale bez obmedzenia) hedžových fondov, fondov investujúcich do verejne neobchodovateľných akcií a realitných fondov (to znamená podielové fondy a /alebo PKIPCP). Uvádzajú sa v členení na tie, ktoré spravuje správcovská spoločnosť a tie, ktoré spravuje iná správcovská spoločnosť.
Investície do iných tried aktív	Ak sa vykazujú informácie o jednotlivých expozíciách, zahŕňajú sa do týchto aktív dlhopisy nečlenských

	štátov EÚ z G10.
Vysvetlivky skratiek	
CDO	
CDS	Collateralized debt obligation (krytý dlhový záväzok)
CLO	Credit default swap (swap na úverové zlyhanie)
CMBS	Collateralized loan obligation (krytý úverový záväzok)
LCDS	Commercial mortgage-backed security (cenný papier krytý hypotekárnym úverom na obchodné nehnuteľnosti)
MBS	Loan credit default swap (swap na úverové zlyhanie na dlh)
RMBS	Mortgage-backed security (cenný papier krytý hypotekárnym úverom)
	Residential mortgage-backed security (cenný papier krytý hypotekárnym úverom na bytové nehnuteľnosti)

