

Look-through UFP – Aplicação da abordagem *look-through* a organismos de investimento coletivo em valores mobiliários (OICVM)

Observações gerais:

Não podem ser preenchidas células que não sejam de cor verde.

ELEMENTO	INSTRUÇÕES
Cabeçalho	
Data	Data a que se reporta a informação (p.e. 31-12-2004)
CE	Código Estatístico da Entidade Reportante
NE	Identificação da Entidade Reportante (Nome abreviado)
ID	Nome do responsável pelo reporte da informação e o departamento onde desempenha funções (p.e. Manuel Simões - Dep. Contabilidade)
LEI	Identificador de Entidade Jurídica. Código alfanumérico de 20 caracteres baseado na norma ISO 17442 desenvolvida pela Organização Internacional de Normalização (ISO), que permite identificar de forma clara e única entidades que participam em transações financeiras e os dados de referência associados
Look-through FI UCITS > 30%	
Código Base do OIC	Preencher com o código base utilizado para o OIC nas folhas Informação sobre posições e Informação sobre ativos.
Tipo de Código do OIC	Preencher com os seguintes números, consoante a origem do código introduzido na coluna anterior: 1 - ISIN 2 - CUSIP 3 - SEDOL 4 - WKN 5 - Bloomberg Ticker 6 - BBGID 7 - Reuters RIC 8 - FIGI 9 - Outro código de membros da ANNA 99 - Código atribuído pela entidade
Designação do Activo	No caso de imóveis indicar a localização dos mesmos.
Designação do Emitente	Preencher com a designação associada ao código LEI do emitente ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal. No caso de fundos de investimento, considera-se que o emitente é a entidade gestora do fundo.
Código do Emitente	Preencher com o código LEI do emitente, não devendo a célula ser preenchida no caso de o mesmo não estar disponível. No caso de fundos de investimento, considera-se que o emitente é a entidade gestora do fundo.
Grupo do Emitente	Preencher com a designação associada ao código LEI da empresa-mãe de topo ou, no caso de o mesmo não estar disponível, a sua designação legal. No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.
Código do Grupo do Emitente	Preencher com o código LEI da empresa-mãe de topo, não devendo a célula ser preenchida no caso de o mesmo não estar disponível. No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.
País do Emitente	Preencher com o código ISO 3166-1 alpha 2 do país de localização do emitente. Para entidades supranacionais ou instituições pertencentes à União Europeia devem ser utilizados, respetivamente, os códigos "XA" e "UE". No caso de fundos de investimento, a relação de grupo a considerar é a da entidade gestora do fundo.

Moeda	Preencher com o código ISO 4217 da moeda da emissão.
CIC	Preencher com o código de identificação complementar previsto no Regulamento de Execução (UE) 2015/2450 da Comissão, de 2 de dezembro de 2015
Organismo de Investimento Alternativo	Preencher com os seguintes números, consoante se trate de um organismo de investimento alternativo: 1 - OIA 2 - Não OIA
Não cotado	Preencher consoante se trate de um valor mobiliário admitido à negociação para efeitos do disposto na alínea a) do n.º 1 do artigo 12.º da Norma Regulamentar n.º 9/2007-R, de 28 de junho: C - Cotado NC - Não cotado
Notação externa do risco de crédito	Preencher com a notação do risco de crédito atribuída ao activo à data a que se reporta a informação, emitida pela instituição de avaliação de crédito ("ECAI").
ECAI	Preencher com a instituição de avaliação de crédito ("ECAI") que emite a notação externa, utilizando uma das opções da lista seguinte: 1 - Euler Hermes Rating GmbH (LEI code: 391200QXGLWHK9VK6V27) 2 - Japan Credit Rating Agency Ltd (LEI code: 35380002378CEGMRVW86) 3 - BCRA-Credit Rating Agency AD (LEI code: 747800Z0IC3P66HTQ142) 4 - Creditreform Rating AG (LEI code: 391200PHL11KDUTTST66) 5 - Scope Ratings GmbH (previously Scope Ratings AG and PSR Rating GmbH)(LEI code: 391200WU1EZUQFHDWE91) 6 - ICAP Group SA (LEI code: 2138008U6LKT8VG2UK85) 7 - GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung GmbH (LEI code: 391200OLWXCTKPADVV72) 8 - ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH (LEI code: 529900977LETWLJF3295) 9 - ARC Ratings, S.A. (previously Companhia Portuguesa de Rating, S.A) (LEI code: 213800OZMJQMVA7D79) 10 - AM Best Europe-Rating Services Ltd. (AMBERS) (LEI code: 549300VO8J8E5IQV1T26) 11 - DBRS Ratings Limited (LEI code: 5493008CGCDQLGT3EH93) 12 - Fitch (to be used when the split below is not available) 13 - Fitch France S.A.S. (LEI code: 2138009Y4TCZT6QOJO69) 14 - Fitch Deutschland GmbH (LEI code: 213800JEMOT1H45VN340) 15 - Fitch Italia S.p.A. (LEI code: 213800POJ9QSCHL3KR31) 16 - Fitch Polska S.A. (LEI code: 213800RYJTJPW2WD5704) 17 - Fitch Ratings España S.A.U. (LEI code: 213800RENFIIODKETE60) 18 - Fitch Ratings Limited (LEI code: 2138009F8YAHVC8W3Q52) 19 - Fitch Ratings CIS Limited (LEI code: 213800B7528Q4DIF2G76) 20 - Moody's (to be used when the split below is not available) 21 - Moody's Investors Service Cyprus Ltd (LEI code: 549300V4LCOYCMNUVR81) 22 - Moody's France S.A.S. (LEI code: 549300EB2XQYRSE54F02) 23 - Moody's Deutschland GmbH (LEI code: 549300M5JMGHVTWYZH47) 24 - Moody's Italia S.r.l. (LEI code: 549300GMXJ4QK70UOU68) 25 - Moody's Investors Service España S.A. (LEI code: 5493005X59ILY4BGJK90) 26 - Moody's Investors Service Ltd (LEI code: 549300SM89WABHDNJ349) 27 - Standard & Poor's (to be used when the split below is not available) 28 - S&P Global Ratings France SAS (LEI code: 54930035REY2YCD5BH09) 29 - S&P Global Ratings Europe Limited (previously S&P Global Ratings Italy S.r.l, LEI 54930000NMOJ7ZBUQ063 – merger of 1 May 2018)(LEI code:5493008B2TU3S6QE1E12) 30 - S&P Global Ratings Italy S.R.L. (LEI code: 54930000NMOJ7ZBUQ063) 31 - Standard & Poor's Credit Market Services Europe Limited (LEI code: 549300363WVTTH0TW460) 32 - CRIF Ratings S.r.l. (previously CRIF S.p.a.) (LEI code: 8156001AB6A1D740F237)

	<p>33 - Capital Intelligence Ratings Ltd (LEI code: 549300RE88OJP9J24Z18) 34 - European Rating Agency, a.s. (LEI code: 097900BFME0000038276) 35 - Axesor Risk Management SL (LEI code: 959800EC2RH76JYS3844) 36 - Axesor conocer para decidir SA (LEI code: 95980020140005900000) 37 - Cerved Rating Agency S.p.A. (previously CERVED Group S.p.A.) (LEI code: 8156004AB6C992A99368) 38 - Kroll Bond Rating Agency (LEI code: 549300QYZ5CZYXTNZ676) 39 - The Economist Intelligence Unit Ltd (LEI code: 213800Q7GRZWF95EWN10) 40 - Dagong Europe Credit Rating Srl (Dagong Europe) (LEI code: 815600BF4FF53B7C6311) 41 - Spread Research (LEI code: 969500HB6BVM2UJDOC52) 42 - EuroRating Sp. z o.o. (LEI code: 25940027QWS5GMO74O03) 43 - HR Ratings de México, S.A. de C.V. (HR Ratings) (LEI code: 549300IFL3XJKTRHZ480) 44 - Moody's Investors Service EMEA Ltd (LEI code: 54930009NU3JYS1HTT72) 45 - Egan-Jones Ratings Co. (EJR) (LEI code: 54930016113PD33V1H31) 46 - modeFinance S.r.l. (LEI code: 815600B85A94A0122614) 47 - INC Rating Sp. z o.o. (LEI code: 259400SUBF5EPOGK0983) 48 - Rating-Agentur Expert RA GmbH (LEI code: 213800P3OOBSGWN2UE81) 49 - Kroll Bond Rating Agency Europe Limited (LEI code: 5493001NGHOLC41ZSK05) 50 - SPMW Rating Sp. z o.o. (LEI code: 259400PIF3W6YC660564) 51 - Other nominated ECAI 52 - Multiple ECAI</p>
Duração	<p>Preencher com a duração modificada residual do ativo à data a que se reporta a informação. No caso de ativos sem maturidade fixa, deve ser utilizada a data da primeira call.</p>
Maturidade	<p>Preencher com o código ISO 8601 (aaaa-mm-dd) da data da maturidade. No caso de obrigações perpétuas, utilizar "9999-12-31".</p>
Quantidade	<p>Preencher, quando aplicável, com a quantidade detida. Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Valor Nominal.</p>
Valor Nominal	<p>Preencher, quando aplicável, com o valor nominal detido. Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Quantidade.</p>
Valor Unitário	<p>Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável % do Valor Nominal.</p>
% do Valor Nominal	<p>Coluna não deve ser preenchida quando for reportada a variável Valor Unitário.</p>
Juros Decorridos	<p>Introduzir os juros decorridos correspondentes a cada título quando aplicável.</p>
Grupo Económico do Associado ou da Entidade Gestora	<p>Preencher consoante o grupo económico a que o emitente pertença: A - Associado EG - Entidade Gestora A/EG - Associado e Entidade Gestora O - Outro</p>