

# Linji Gwida

**għar-rapportar skont I-EMIR**

## Werrej

|                                                                                                                                         |    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| Anness: Linji Gwida għar-rapportar skont l-EMIR .....                                                                                   | 6  |
| 1 Referenzi leġislattivi, taqsiriet u definizzjonijiet .....                                                                            | 6  |
| 1 Kamp ta' applikazzjoni.....                                                                                                           | 10 |
| 2 Għan .....                                                                                                                            | 10 |
| 3 Principji Ġenerali .....                                                                                                              | 12 |
| 3.1 It-Tranżizzjoni għar-rapportar skont l-RTS u l-ITS dwar ir-rapportar .....                                                          | 12 |
| 3.2 Id-determinazzjoni tan-numru ta' derivati li jistgħu jiġu rrapportati.....                                                          | 13 |
| 3.2.1 Prodotti li jistgħu jiġu rrapportati .....                                                                                        | 13 |
| 3.2.2 Obbligu ta' rapportar fir-rigward tal-partijiet involuti fin-negozju. ....                                                        | 16 |
| 3.2.3 Ir-rapportabbiltà f'xenarji speċifiċi .....                                                                                       | 19 |
| 3.3 L-eżenzjoni tal-intragrupp mir-rapportar.....                                                                                       | 20 |
| 3.4 L-allokazzjoni tar-responsabbiltà għar-rapportar.....                                                                               | 25 |
| 3.4.1 Kjarifiki ġenerali.....                                                                                                           | 25 |
| 3.4.2 Il-kummerċ tal-FC ma' NFC.....                                                                                                    | 26 |
| 3.4.3 CCP .....                                                                                                                         | 32 |
| 3.4.4 Fondi (UCITS, AIF u IORP li, f'konformità mal-liġi nazzjonali, m'għandhomx personalità ġuridika) .....                            | 33 |
| 3.5 Id-delega tar-rapportar .....                                                                                                       | 35 |
| 3.6 Ir-rapportar tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja .....                                                                              | 37 |
| 3.6.1 Tipi ta' azzjoni .....                                                                                                            | 37 |
| 3.6.2 Kombinamenti tat-tipi ta' azzjoni u tat-tipi ta' event .....                                                                      | 40 |
| 3.6.3 L-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja u l-użu tal-IDs ta' kollegament (UTI preċedenti, ID PTRR, UTI tal-pożizzjoni sussegwenti) ..... | 47 |
| 3.7 Ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni .....                                                                                        | 48 |
| 3.8 Ir-rapportar tad-derivattivi fiċ-ċentru.....                                                                                        | 52 |
| 3.9 Ir-rapportar puntwali tal-konklużjoni, tal-modifika u tat-terminazzjoni ta' derivattivi ..                                          | 58 |
| 3.9.1 Konklużjoni ta' derivattivi .....                                                                                                 | 58 |
| 3.9.2 Modifika jew korrezzjoni ta' derivattivi .....                                                                                    | 58 |
| 3.9.3 Rapportar tal-aġġornamenti tal-margni u tal-valwazzjoni.....                                                                      | 59 |
| 3.9.4 Terminazzjoni ta' derivattivi .....                                                                                               | 59 |

|       |                                                                                                  |     |
|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 3.10  | Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjonijiet.....              | 61  |
| 3.11  | Ġenerazzjoni tal-UTI .....                                                                       | 71  |
| 3.12  | Determinazzjoni tan-naħa tal-kontroparti .....                                                   | 75  |
| 3.13  | Identifikazzjoni tal-kontropartijiet.....                                                        | 77  |
| 3.14  | Proċedura meta kontroparti tgħaddi minn azzjoni korporattiva .....                               | 79  |
| 3.15  | Identifikazzjoni u klassifikazzjoni tal-prodotti.....                                            | 82  |
| 3.16  | Identifikazzjoni tas-sottostanti.....                                                            | 83  |
| 3.17  | Kampijiet tal-prezz, tan-nozzjonali u tal-kwantità .....                                         | 84  |
| 3.18  | Rapportar tal-valwazzjonijiet.....                                                               | 87  |
| 3.19  | Rapportar tal-marġni .....                                                                       | 91  |
| 3.20  | Identifikazzjoni taċ-ċentru tan-negozjar .....                                                   | 98  |
| 3.21  | Kampijiet relatati mal-ikklerjar.....                                                            | 99  |
| 3.22  | Kampijiet relatati mal-konferma .....                                                            | 100 |
| 3.23  | Kampijiet relatati mas-saldu .....                                                               | 101 |
| 3.24  | Rapportar tal-pagamenti regolari .....                                                           | 101 |
| 3.25  | Rapportar ta' pagamenti oħra.....                                                                | 102 |
| 3.26  | Kampijiet tad-dati u tal-kronogrammi .....                                                       | 103 |
| 3.27  | Rapportar tad-derivattivi dwar il-kriptoassi.....                                                | 104 |
| 3.28  | Rapportar ta' prodotti kumplessi.....                                                            | 105 |
| 3.29  | L-iżgurar tal-kwalità tad-data mill-kontropartijiet.....                                         | 107 |
| 4     | Rapportar għal kull tip ta' prodott.....                                                         | 113 |
| 4.1   | Rapportar tal-lswap ta' rata tal-imġax .....                                                     | 114 |
| 4.2   | Rapportar tas-swapzjonijiet .....                                                                | 116 |
| 4.2.1 | Swapzjoni fuq swap ta' rata tal-imġax minn fiss għal varjabbli.....                              | 116 |
| 4.3   | Rapportar ta' prodotti IR oħra .....                                                             | 123 |
| 4.4   | Rapportar tal-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju u tal-kuntratti forward tal-kambju..... | 124 |
| 4.4.1 | Swaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju (spot-forward u forward-forward).....                  | 124 |
| 4.4.2 | Kompressjoni tal-komponent inizjali tal-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju.....           | 131 |
| 4.4.3 | Opzjoni FX .....                                                                                 | 141 |
| 4.4.4 | Iktar kunsiderazzjonijiet dwar ir-rapportar tal-muniti.....                                      | 144 |
| 4.5   | Rapportar tal-NDFs .....                                                                         | 144 |
| 4.5.1 | NDF .....                                                                                        | 144 |
| 4.6   | Rapportar tas-CFDs .....                                                                         | 146 |

|       |                                                                                                                                  |     |
|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 4.6.1 | CFD .....                                                                                                                        | 147 |
| 4.7   | Rapportar tad-derivattivi ta' ekwità .....                                                                                       | 149 |
| 4.7.1 | Swap tad-dividendi .....                                                                                                         | 150 |
| 4.8   | Rapportar ta' derivattivi ta' kreditu .....                                                                                      | 154 |
| 4.8.1 | CDS .....                                                                                                                        | 156 |
| 4.9   | Rapportar ta' derivattivi ta' komoditajiet .....                                                                                 | 161 |
| 4.9.1 | Futuri tal-elettriku .....                                                                                                       | 162 |
| 5     | Tabelli tal-kampijiet tal-EMIR .....                                                                                             | 164 |
| 5.1   | Tabella 1 <i>Data</i> dwar il-kontroparti .....                                                                                  | 165 |
| 5.1.1 | Opzjoni kklerjata bejn I-FCs (ETD) .....                                                                                         | 165 |
| 5.1.2 | Opzjoni kklerjata bejn I-FCs bi ftehim ta' delega volontarja (ETD) .....                                                         | 167 |
| 5.1.3 | Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs .....                                                                                         | 169 |
| 5.1.4 | Opzjoni OTC bejn NFC- u FC .....                                                                                                 | 171 |
| 5.1.5 | Opzjoni OTC bejn NFC- u NFC+ .....                                                                                               | 172 |
| 5.1.6 | Tip ta' kuntratt OTC li jehtieg il-mili tal-kampijiet "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" bejn FCs ..... | 174 |
| 5.2   | Tabella 2 <i>Data</i> komuni .....                                                                                               | 176 |
| 5.2.1 | Ir-rapportar tat-tipi ta' azzjoni fil-livell tan-negozju u fil-livell tal-pożizzjoni .....                                       | 176 |
| 5.2.2 | Detalji rapportabbli oħra .....                                                                                                  | 192 |
| 5.3   | Tabella 3 <i>Data</i> dwar il-marġni .....                                                                                       | 211 |
| 5.3.1 | Ir-rapportar tal-aġġornament tal-marġni għal derivattiv ġdid mhux kollateralizzat .....                                          | 212 |
| 5.3.2 | Ir-rapportar ta' marġni għal derivattiv ġdid kollateralizzat fil-livell tal-portafoll .....                                      | 212 |
| 5.3.3 | Ir-rapportar ta' aġġornament tal-marġni fil-livell ta' tranżazzjoni individwali għal derivattiv mhux ikklerjat .....             | 215 |
| 6     | Linji Gwida dwar il-ġestjoni tad- <i>data</i> tad-derivattivi .....                                                              | 219 |
| 6.1   | Rapport dwar l-Istat tan-Negozju .....                                                                                           | 219 |
| 6.1.1 | Introduzzjoni .....                                                                                                              | 219 |
| 6.1.2 | Trattament tad- <i>data</i> tal-event .....                                                                                      | 219 |
| 6.1.3 | Natura unika tad-derivattivi u kampijiet speċjali .....                                                                          | 226 |
| 6.1.4 | Trattament tat-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid" .....                                                                            | 227 |
| 6.1.5 | Rapportar bit-tip ta' azzjoni "EROR" u "REVI" .....                                                                              | 229 |
| 6.1.6 | Inklużjoni fit-TSR ta' informazzjoni dwar l-iskeda .....                                                                         | 229 |
| 6.1.7 | Derivattivi mejtin .....                                                                                                         | 230 |
| 6.2   | Rikonċiljazzjoni .....                                                                                                           | 231 |

|       |                                                                              |     |
|-------|------------------------------------------------------------------------------|-----|
| 6.2.1 | Kamp ta' applikazzjoni tad- <i>data</i> soġġetta għar-rikonċiljazzjoni ..... | 231 |
| 6.2.2 | Rikonċiljazzjoni fil-livell tal-pożizzjoni vs fil-livell tan-negozju .....   | 232 |
| 6.2.3 | Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni.....                                        | 233 |
| 6.2.4 | Derivattivi b'żewġ komponenti .....                                          | 234 |
| 6.2.5 | Rikonċiljazzjoni tal-informazzjoni dwar l-iskeda .....                       | 234 |
| 6.3   | Feedback dwar il-kwalità tad- <i>data</i> .....                              | 234 |
| 6.3.1 | Feedback dwar ir-rifjut.....                                                 | 234 |
| 6.3.2 | Feedback ta' twissijiet .....                                                | 240 |
| 6.3.3 | Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni.....                                       | 248 |
| 6.4   | Aċċess għad- <i>data</i> .....                                               | 252 |
| 6.4.1 | Aspetti operattivi.....                                                      | 252 |
| 6.4.2 | Mudell tal-formola għall-aċċess għad- <i>data</i> .....                      | 255 |
| 6.4.3 | Kampijiet tal-EMIR għall-iffiltrar tad- <i>data</i> .....                    | 260 |



## Anness: Linji Gwida għar-rapportar skont l-EMIR

### 1 Referenzi legiżlattivi, taqsiriet u definizzjonijiet

#### Referenzi legiżlattivi

##### *EMIR*

Ir-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet - Ir-Regolament dwar l-Infrastruttura tas-Suq Ewropew<sup>1</sup>

##### *SFTR*

Ir-Regolament (UE) 2015/2365 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-25 ta' Novembru 2015 dwar it-trasparenza ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli u l-użu mill-ġdid u li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012<sup>2</sup> – Ir-Regolament dwar it-Tranżazzjonijiet ta' Finanzjament tat-Titoli

##### *RTS dwar ir-rapportar*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2022/1855 tal-10 ta' Ġunju 2022 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji li jispeċifikaw id-dettalji minimi tad-*data* li għandha tiġi rrapportata lir-repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet u t-tip ta' rapporti li għandhom jintużaw<sup>3</sup>

##### *ITS dwar ir-rapportar*

Ir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2022/1860 tal-10 ta' Ġunju 2022 li jistabbilixxi standards tekniċi ta' implimentazzjoni għall-applikazzjoni tar-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet, fir-rigward tal-istandards, il-formati, il-frekwenza u l-metodi u l-arrangamenti għar-rapportar u li jħassar ir-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 1247/2012<sup>4</sup>

---

<sup>1</sup> ĠU L 201, 27.7.2012, p.1

<sup>2</sup> ĠU L 337, 23.12.2015, p. 1

<sup>3</sup> ĠU L 262, 7.10.2022, p. 1

<sup>4</sup> ĠU L 262, 7.10.2022, p.68.

*RTS dwar ir-  
registrazzjoni*

Ir-Regolament ta' Delega tal-Kummissjoni (UE) Nru 150/2013 tad-19 ta' Diċembru 2012 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet rigward standards tekniċi regolatorji li jispesifikaw id-dettalji tal-applikazzjoni għar-registrazzjoni bħala repożitorju tat-tranżazzjonijiet, kif emendat mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2019/362 tat-13 ta' Diċembru 2018 <sup>5</sup> u mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2022/1857<sup>6</sup>

*RTS dwar il-kwalità tad-  
data*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2022/1858 tal-10 ta' Ġunju 2022 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet, fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji li jispesifikaw il-proċeduri għar-rikonċiljazzjoni tad-*data* bejn ir-repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet u l-proċeduri li għandhom jiġu applikati mir-repożitorju tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet biex jivverifika l-konformità mill-kontroparti li tirrapporta jew mill-entità li tressaq ir-rapport mar-rekwiżiti tar-rapportar u biex jivverifika l-kompletezza u l-korrettezza tad-*data* rrapportata<sup>7</sup>

*RTS dwar l-aċċess  
għad-data*

Ir-Regolament ta' Delega tal-Kummissjoni (UE) Nru 151/2013 tad-19 ta' Diċembru 2012 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet fir-rigward ta' standards tekniċi regolatorji li jispesifikaw id-*data* li trid tiġi ppubblikata u li għandha tkun disponibbli minn repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet u standards operazzjonali biex tiġi aggregata, imqabbla u aċċessata d-*data*, kif emendat mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2017/1800 u mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2019/361, kif emendat mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2022/1856<sup>8</sup>

---

<sup>5</sup> ĠU L 52, 23.2.2013, p. 25

<sup>6</sup> ĠU L 262, 7.10.2022, p. 41

<sup>7</sup> ĠU L 262, 7.10.2022, p. 46.

<sup>8</sup> ĠU L 262, 7.10.2022, p.34.

*RTS dwar ir-rekwiżiti  
tal-organizzazzjoni*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2017/565 tal-25 ta' April 2016 li jissupplimenta d-Direttiva 2014/65/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill rigward rekwiżiti organizzazzjonali u kundizzjonijiet għall-operat għal ditti tal-investiment u termini definiti għall-finijiet ta' dik id-Direttiva

**Taqsiriet**

|                        |                                                                                                                                                                                           |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <i>BĊE</i>             | Bank Ċentrali Ewropew                                                                                                                                                                     |
| <i>CCP</i>             | Kontroparti Ċentrali                                                                                                                                                                      |
| <i>CM</i>              | Membru tal-Ikklijar                                                                                                                                                                       |
| <i>CP</i>              | Dokument ta' diskussjoni dwar il-Linji Gwida dwar ir-Rapportar skont l-EMIR                                                                                                               |
| <i>CP dwar RTS/ITS</i> | Dokument ta' diskussjoni dwar l-istandards tekniċi dwar ir-rapportar, il-kwalità tad- <i>data</i> , l-aċċess għad- <i>data</i> u r-reġistrazzjoni tat-TRs skont l-EMIR REFIT <sup>9</sup> |
| <i>CPMI</i>            | Kumitat dwar il-Pagamenti u l-Infrastrutturi tas-Suq                                                                                                                                      |
| <i>ERR</i>             | Entità responsabbli mir-rapportar                                                                                                                                                         |
| <i>ESMA</i>            | Awtorità Ewropea tat-Titoli u s-Swieq                                                                                                                                                     |
| <i>FIRDS</i>           | Sistema ta' <i>Data</i> ta' Referenza tal-Istrumenti Finanzjarji                                                                                                                          |

---

<sup>9</sup> [https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-47\\_cp\\_on\\_the\\_ts\\_on\\_reporting\\_data\\_quality\\_data\\_access\\_and\\_registration\\_of\\_trs\\_under\\_emir\\_refit.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-47_cp_on_the_ts_on_reporting_data_quality_data_access_and_registration_of_trs_under_emir_refit.pdf)

|                        |                                                                                                                                                                                  |
|------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <i>FR dwar RTS/ITS</i> | Rapport finali dwar l-istandards tekniċi dwar ir-rapportar, il-kwalità tad- <i>data</i> , l-aċċess għad- <i>data</i> u r-reġistrazzjoni tat-TRs skont l-EMIR REFIT <sup>10</sup> |
| <i>FSB</i>             | Bord għall-Istabilità Finanzjarja                                                                                                                                                |
| <i>ĠU</i>              | Il-Ġurnal Uffiċjali tal-Unjoni Ewropea                                                                                                                                           |
| <i>IOSCO</i>           | Organizzazzjoni Internazzjonali tal-Kummissjonijiet tat-Titoli                                                                                                                   |
| <i>ISIN</i>            | Numru Internazzjonali għall-Identifikazzjoni tat-Titoli                                                                                                                          |
| <i>ISO</i>             | Organizzazzjoni Internazzjonali għall-Istandardizzazzjoni                                                                                                                        |
| <i>ITS</i>             | Standards Tekniċi ta' Implimentazzjoni                                                                                                                                           |
| <i>KE</i>              | Kummissjoni Ewropea                                                                                                                                                              |
| <i>Kodiċi CFI</i>      | Klassifikazzjoni tal-Kodiċi tal-Istrumenti Finanzjarji                                                                                                                           |
| <i>LEI</i>             | Identifikatur ta' entità ġuridika                                                                                                                                                |
| <i>MIC</i>             | Kodiċi ta' identifikazzjoni tas-suq                                                                                                                                              |
| <i>NCA</i>             | Awtorità Nazzjonali Kompetenti                                                                                                                                                   |
| <i>OTC</i>             | Barra l-Borża                                                                                                                                                                    |
| <i>Q&amp;A</i>         | Mistoqsijiet u Tweġibiet                                                                                                                                                         |
| <i>RSE</i>             | Entità li tippreżenta rapport                                                                                                                                                    |
| <i>RTS</i>             | Standards Tekniċi Regulatorji                                                                                                                                                    |
| <i>SEBC</i>            | Sistema Ewropea ta' Banek Ċentrali                                                                                                                                               |

<sup>10</sup>

[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-824\\_fr\\_on\\_the\\_ts\\_on\\_reporting\\_data\\_quality\\_data\\_access\\_and\\_registration\\_of\\_trs\\_under\\_emir\\_refit\\_0.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-824_fr_on_the_ts_on_reporting_data_quality_data_access_and_registration_of_trs_under_emir_refit_0.pdf)

|              |                                                                   |
|--------------|-------------------------------------------------------------------|
| <i>SWIFT</i> | Soċjetà għat-Telekomunikazzjoni Finanzjarja Interbankarja Dinjija |
| <i>TR</i>    | Repożitorju tad- <i>data</i> dwar it-tranżazzjonijiet             |
| <i>UE</i>    | Unjoni Ewropea                                                    |
| <i>UTI</i>   | Identifikatur Uniku tat-Tranżazzjoni                              |
| <i>XML</i>   | Extensible Markup Language                                        |
| <i>XSD</i>   | Definizzjoni ta' Skema XML                                        |
| <i>ŻEE</i>   | Żona Ekonomika Ewropea                                            |

## 1 Kamp ta' applikazzjoni

### Min?

1. Dawn il-Linji Gwida se japplikaw għall-kontropartijiet finanzjarji u mhux finanzjarji, għad-derivattivi kif definiti fl-Artikoli 2(8) u 2(9) tal-EMIR, għar-repożitorji tad-*data* dwar it-tranżazzjonijiet (TRs) kif definiti fl-Artikolu 2(2) tal-EMIR u għall-awtoritajiet kompetenti.

### Xiex?

2. Dawn il-Linji Gwida se japplikaw fir-rigward tal-obbligu ta' rapportar tad-derivattivi kif iddikjarat fl-Artikolu 9 tal-EMIR u l-obbligi tat-TRs skont l-Artikoli 78 u 81 tal-EMIR.

### Meta?

3. Dawn il-Linji Gwida se japplikaw mid-29 ta' April 2024.

## 2 Għan

4. Dawn il-Linji Gwida huma bbażati fuq l-Artikolu 16(1) tar-Regolament tal-ESMA. Huma jaqdu diversi skopijiet fir-rigward tal-armonizzazzjoni u tal-istandardizzazzjoni tar-rapportar skont l-EMIR. Dan huwa essenzjali biex tiġi żgurata kwalità għolja tad-*data* neċessarja għall-monitoraġġ effettiv tar-riskju sistemiku. Barra minn hekk, armonizzazzjoni u standardizzazzjoni akbar tar-

rapportar jippermettu li l-ispejjeż jiġu limitati tul il-katina sħiħa ta' rapportar - il-kontropartijiet li jirrapportaw id-*data*, it-TRSs li jimplimentaw il-proċeduri biex jivverifikaw il-kompletezza u l-korrettezza tad-*data*, u l-awtoritajiet, iddefiniti fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR li jużaw id-*data* għal skopijiet superviżorji u regolatorji. Il-Linji Gwida jipprovdu kjarifiki dwar l-aspetti li ġejjin:

- a. it-tranżizzjoni għar-rapportar skont ir-regoli l-ġodda,
- b. in-numru ta' derivattivi li jistgħu jiġu rrapportati,
- c. l-eżenzjoni tad-derivattivi intragrupp mir-rapportar,
- d. id-delega tar-rapportar u l-allokazzjoni tar-responsabbiltà għar-rapportar,
- e. il-loġika tar-rapportar u l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar,
- f. ir-rapportar tat-tipi differenti ta' derivattivi,
- g. l-iżgurar tal-kwalità tad-*data* mill-kontropartijiet u mit-TRSs,
- h. Il-bini tar-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju u r-rikonċiljazzjoni tad-derivattivi mit-TRSs,
- i. l-aċċess għad-*data*.

## 3 Prinċipji Ġenerali

### 3.1 It-Tranżizzjoni għar-rapportar skont I-RTS u I-ITS dwar ir-rapportar

5. Ir-rapporti kollha ppreżentati mill-kontropartijiet lit-TRs wara l-bidu tar-rapportar skont I-RTS u I-ITS dwar ir-rapportar se jkollhom jikkonformaw mar-rekwiżiti emendati. Dan japplika għar-rapporti tad-derivattivi konklużi wara d-data tal-bidu tar-rapportar u għal kwalunkwe modifika jew terminazzjoni rrapportata wara dik id-data, irrISPettivament minn meta ġie konkluż id-derivattiv modifikat jew terminat.
6. B'mod ġenerali, kwalunkwe avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja li jista' jiġi rrapportat se jeħtieġ li jiġi rrapportat f'konformità mar-rekwiżiti riveduti.
7. F'konformità mal-Artikolu 10 tal-ITS dwar ir-rapportar, il-kontropartijiet għandhom jaġġornaw id-derivati pendenti kollha taġġhom biex jikkonformaw mar-rekwiżiti tar-rapportar riveduti fi żmien 180 jum kalendarju mid-data tal-bidu tar-rapportar billi jipprezentaw rapport b'tip ta' event "Aġġornament", sakemm ma jkunux ipprezentaw rapport bit-tip ta' azzjoni "Modifika" jew "Korrezzjoni" (korrezzjoni tad-dettalji tal-kummerċ<sup>11</sup>) għal tali derivati f'dan il-perijodu (peress li "Modifika" u "Korrezzjoni" se jkunu messaġġi sħaħ, għalhekk ir-rapportar ta' modifika jew ta' korrezzjoni tad-derivat se jeħtieġ il-provvediment tad-dettalji kollha rilevanti ta' dak id-derivat).
8. Jekk il-kontroparti ma tirrapportax fi żmien il-perjodu ta' tranżizzjoni ta' 180 jum kwalunkwe modifika jew kwalunkwe korrezzjoni tad-derivat, għandha tippreżenta rapport billi tuża kombinament tat-tip ta' azzjoni "Modifika" u tat-tip ta' event "Aġġornament", filwaqt li timla d-dettalji kollha rilevanti f'konformità mal-RTS u mal-ITS dwar ir-rapportar.
9. Anki jekk kontroparti tirrapporta aġġornamenti tal-kollateral u tal-valwazzjoni ta' kuljum, iżda l-ebda modifika jew korrezzjoni ma tiġi rrapportata matul il-perjodu ta' tranżizzjoni għal deriva partikolari, il-kontroparti għandha taġġorna dak id-derivat.
10. Jekk id-deriva jimmatura jew jiġi terminat matul il-perjodu ta' tranżizzjoni, il-kontropartijiet ma jeħtieġx li jibgħatu r-rapport bit-tip ta' event "Aġġornament" meta ma seħħet l-ebda modifika li tista' tiġi rrapportata.
11. Id-derivati pendenti kollha, kemm f'livell tan-negozju kif ukoll tal-pożizzjonijiet, għandhom jiġu aġġornati. Id-derivati fil-livell tan-negozju li kienu inklużi f'pożizzjoni mhumix pendenti u għalhekk m'għandhomx jiġu aġġornati. Id-derivat korrispondenti fil-livell tal-pożizzjonijiet biss għandu jiġi aġġornat, sa fejn ikun pendenti fid-data tal-bidu tar-rapportar.

---

<sup>11</sup> It-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni" se tippermetti l-korrezzjoni tad-data dwar it-tranżazzjoni jew tad-data dwar it-tranżazzjoni u dwar il-valwazzjoni jew tad-data dwar il-marġni. Ir-rapport bit-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni" relatat mad-data dwar it-tranżazzjoni jew mad-data dwar it-tranżazzjoni u dwar il-valwazzjoni biss se jiżgura l-aġġornament tat-taqsimiet kollha rilevanti ta' derivat. Id-data dwar il-valwazzjoni u dwar il-marġni se tiġi aġġornata f'kwalunkwe każ billi jintbagħtu r-rapporti tal-valwazzjoni u tal-marġni ta' kuljum (tipi ta' azzjoni "Valwazzjoni" u "Aġġornament tal-marġni", rispettivament)

12. Negożji li ġew itterminati jew li jkunu mmaturaw m'għandhomx jiġu aġġornati u rrapportati mill-ġdid. Dan huwa mingħajr preġudizzju għat-trażmissjoni ta' rapporti bħall-modifiki u bħall-korrezzjonijiet fir-rigward ta' avvenimenti li għaddew għal negożji li ġew itterminati jew li jkunu mmaturaw, fejn rilevanti.
13. Jekk kontroparti tiftaħ mill-ġdid derivat li mhux aġġornat b'tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid", kemm jekk matul il-perjodu ta' tranżizzjoni kif ukoll jekk wara, għandha tipprovdi d-dettalji kollha rilevanti tad-derivat mid-data tal-ftuħ mill-ġdid, bħal f'kwalunkwe rapport iehor ta' "Ftuħ mill-ġdid".
14. Il-perjodu ta' tranżizzjoni ma jaffettwa bl-ebda mod l-obbligu skont l-Artikolu 9 tal-EMIR li jiġu rrapportati l-avvenimenti rilevanti sa T+1. Għalhekk kwalunkwe konkluzjoni, modifika jew terminazzjoni ta' derivat li sseħħ wara d-data tal-bidu tar-rapportar, għandha tiġi rrapportata kif xieraq sat-tmiem tal-jum tax-xogħol li jmiss (T+1), anki jekk isseħħ matul il-perjodu ta' tranżizzjoni ta' 6 xhur.
15. Matul il-perjodu ta' tranżizzjoni, it-TRs għandhom jinkludu d-derivati pendenti kollha fil-proċess ta' rikonċiljazzjoni, irrISPettivament minn jekk ġewx aġġornati jew le. It-taqsimiet meħtieġa skont l-RTS u l-ITS dwar ir-rapportar se jkunu soġġetti għar-rikonċiljazzjoni kif speċifikat fl-Anness għall-RTS dwar il-kwalità tad-data. It-taqsimiet li ġew irrapportati fil-passat iżda li m'għadhomx meħtieġa skont l-RTS u l-ITS dwar ir-rapportar mhux se jiġu rikonċiljati.
16. Il-kontropartijiet m'għandhomx joħolqu UTI ġdid għal derivati pendenti, anki jekk il-UTI originali ma jikkonformax bi sħiħ mar-rekwiżiti tal-format ġodda skont l-RTS u l-ITS dwar ir-rapportar. Dan japplika wkoll għat-taqsimi 2.3 "UTI preċedenti" u għat-taqsimi 2.4 "UTI tal-pożizzjoni sussegwenti".
17. F'konformità mar-regoli ta' validazzjoni tal-EMIR, it-TRs m'għandhomx jirrifjutaw ir-rapporti minhabba l-UTIs li ma jikkonformawx bi sħiħ mar-rekwiżiti l-ġodda għal daww id-derivati li ġew konkluzi qabel id-data tal-bidu tar-rapportar tal-RTS u tal-ITS dwar ir-rapportar.
18. Fil-każ tat-trasferiment tad-data bejn it-TRs, qabel it-trasferiment tad-data t-TRs għandhom jiżguraw li l-partecipanti fit-TR itejbu d-derivati pendenti li huma soġġetti għat-trasferiment tad-data għar-rekwiżit ta' rapportar l-aktar aġġornat<sup>12</sup>.

## 3.2 Id-determinazzjoni tan-numru ta' derivati li jistgħu jiġu rrapportati

### 3.2.1 Prodotti li jistgħu jiġu rrapportati

19. L-Artikolu 9(1) tal-EMIR jiddikjara li "il-kontropartijiet u s-CCPs għandhom jiżguraw li d-dettalji ta' kwalunkwe kuntratt tad-derivati li jkunu kkonkludew u kwalunkwe modifika jew terminazzjoni tal-kuntratt jiġu rrapportati lil repożitorju tat-tranżazzjonijiet [...]". Kuntratt tad-derivat jew derivat huwa definit fl-Artikolu 2(5) tal-

---

<sup>12</sup> Ara l-Linja Gwida 11 fil-[ESMA74-362-2351 Guidelines on transfer of data between Trade Repositories under EMIR and SFTR](#)

EMIR bħala strument finanzjarju kif stabbilit fil-punti (4) sa (10) tat-Taqsima C tal-Anness I għall-MiFID. Fl-aħħar ftit snin tqajmu diversi incertezzi fir-rigward tal-kwalifika ta' ċerti kuntratti bħala derivati. Din it-taqsima għandha l-għan li tipprovdi kjarifika lill-parteciċipanti tas-suq filwaqt li jitqies l-istat attwali tar-regolamenti.

#### Derivati bbażati fuq munita

20. L-RTS dwar ir-rekwiżiti tal-organizzazzjoni fil-MiFID għad-ditti tal-investment<sup>13</sup> jiċċara fl-Artikolu 10 l-karatteristiċi ta' kuntratti tad-derivati oħra relatati mal-muniti li jippermetti li ssir differenza bejn kuntratti spot li mhumix derivati u kuntratti forward li huma kuntratti derivati. Fil-prinċipju, u b'mod partikolari għall-pari muniti ewlenin, kuntratt ta' kambju jitqies bħala derivat jekk il-kunsinna hi maħsuba li sseħħ mill-inqas 3 ijiem ta' negozjar wara t-twettiq tal-kuntratt, filwaqt li f'xi ċirkostanzi dan il-limitu jista' jiġi estiż abbażi tal-prattiki standard tas-suq. Abbażi tal-elementi ta' hawn fuq, kuntratti ta' kambju forward jistgħu jiġu rrapportati skont l-EMIR filwaqt li l-kuntratti ta' kambju spot ma jistgħux.
21. Bħala illustrazzjoni, kuntratt ta' kambju li qed ibigh EUR X u li qed jixtri USD Y innegożjat it-Tnejn 4 ta' Jannar 2021 u saldat il-Ħamis 7 ta' Jannar 2021 huwa kuntratt forward u li jista' jiġi rrapportat skont l-EMIR. Kuntratt ta' kambju simili nnegożjat it-Tnejn 4 ta' Jannar 2021 u saldat l-Erbgħa 6 ta' Jannar 2021 huwa kuntratt spot u li ma jistax jiġi rrapportat skont l-EMIR.
22. Kuntratt ta' kambju li qed ibigh EUR X u li qed jixtri ZAR Z innegożjat it-Tnejn 4 ta' Jannar 2021 u saldat l-Erbgħa 6 ta' Jannar 2021, li għalih it-tranzazzjoni ssir sabiex tinx tara ekwità nnegożjat fil-JSE<sup>14</sup> b'ċiklu tas-saldu T+3 mhuwix derivat u għalhekk mhuwix soġġett għar-rapportar skont l-EMIR abbażi tal-fatt li meta kuntratt ta' kambju jkun marbut max-xiri ta' titoli transferibbli jew mal-unitajiet ta' intrapriża għal investment kollettiv, huwa jitqies bħala derivat meta l-kunsinna sseħħ wara l-perjodu ta' kunsinna tas-suq fejn it-titoli trasferibbli jew l-unitajiet f'intrapriża ta' investment kollettiv f'titoli trasferibbli (UCITS) jiġu nnegożjati jew wara 5 ijiem, skont liema tkun l-iqsar.
23. Barra minn hekk, l-Artikolu 10 jipprevedi li "kuntratt ma jiġix ikkunsidrat bħala kuntratt spot jekk, irrispettivament mit-termini espliciti tiegħu, ikun hemm arrangament bejn il-partijiet għall-kuntratt li l-konsenja tat-titolu sottostanti għandha tiġi posposta u m'għandhiex titwettaq fil-perjodu" imsemmi fil-paragrafi ta' hawn fuq.
24. Għal swaps, fil-bidu għandha ssir distinzjoni bejn is-swaps bejn il-muniti u s-swaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju. Is-swaps bejn il-muniti huma kuntratti li fihom kemm fattur tar-rata tal-imgħax u fattur tal-munita. Huma jitqiesu bħala derivattvi tar-rati tal-imgħax u għandhom jiġu rrapportati bħala tali skont l-EMIR. Kuntrarju għal dan, is-swaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju jinvolvu biss fattur tas-suq tal-muniti barranin (jiġifieri b'mod ġenerali ma jseħħu l-ebda pagamenti interim). Swap

<sup>13</sup> Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2017/565 tal-25 ta' April 2016 li jissupplimenta d-Direttiva 2014/65/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill rigward rekwiżiti organizzazzjonali u kundizzjonijiet għall-operat għal ditti tal-investment u termini definiti għall-finijiet ta' dik id-Direttiva (Test b'rilevanza għaž-ŻEE)

<sup>14</sup> [Equity Market Risk Management | Johannesburg Stock Exchange \(jse.co.za\)](http://www.jse.co.za)

tal-valuti skont ir-rata tal-kambju huwa derivattiv magħmul minn 2 komponenti, komponent inizjali u komponent finali. Irrispettivament minn jekk il-komponent inizjali huwa spot jew forward, is-swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju għandu jiġi rrapportat bħala derivattiv wieħed iktar milli kombinament ta' derivattivi. Aktar dettalji dwar kif dawn id-derivattivi għandhom jiġu rrapportati jinsabu fit-taqsima 4.4.

#### Derivattivi fuq il-kriptoassi

25. Id-derivattivi fuq il-kriptoassi li jissodisfaw id-definizzjoni ta' "derivattiv" jew "kuntratt tad-derivattiv" skont l-EMIR biss huma mistennija li jiġu rrapportati.
26. Għar-rrapportar tad-dettalji tad-derivattivi, il-kontropartijiet għandhom jiddependu mill-qafas regolatorju li huwa applikabbli. Għalhekk, jekk id-derivattiv fuq kriptoassi jitqies bħala strument finanzjarju skont il-MiFID, għandu jiġi rrapportat f'konformità mal-karatteristiċi tiegħu.
27. F'każ fejn il-kontroparti tidhol f'kuntratt tad-derivattiv ma' kriptoassi bħala l-istrument finanzjarju sottostanti, għandha timla l-kamp 2.12 "Derivattiv ibbażat fuq il-kriptoassi" b'"Veru".

#### Swaps tar-redditu totali, swaps tal-likwidità jew swaps kollaterali (relatati mal-SFTR)

28. Ċerti obbligi relatati mas-swaps tar-redditu totali (TRS) huma inklużi fl-SFTR, b'mod partikolari fil-Kapitolu IV relatat mat-Trasparenza fil-konfront tal-investituri. Madankollu, TRS huma derivattivi u għalhekk jistgħu jiġu rrapportati skont l-EMIR u mhux skont l-SFTR. Id-definizzjoni fl-Artikolu 3(18) tal-SFTR tiddikjara b'mod ċar li TRS "tfisser kuntratt tad-derivattivi kif definit fil-punt (7) tal-Artikolu 2 tar-Regolament (UE) Nru 648/2012 fejn kontroparti tittrasferixxi l-prestazzjoni ekonomika totali, inkluż dħul minn imghax u tariffi, qligħ jew telf minn moviment tal-prezzijiet, u telf ta' kreditu, ta' obbligu referenzjarju lil kontroparti oħra." Għandu jiġi nnotat li skont is-sottostanti, it-TRS għandhom jiġu rrapportati bħala derivattivi ta' kreditu jew bħala derivattivi ta' ekwità. Id-dettalji dwar kif dawn għandhom jiġu rrapportati jistgħu jinsabu fit-taqsimiet 4.7 u 4.8.
29. Barra minn hekk, il-Premessa 7 tal-SFTR tiċċara li xi tranżazzjonijiet li huma magħrufa b'mod komuni bħala swaps tal-likwidità u swaps kollaterali, li ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta' "kuntratti tad-derivattivi" skont l-EMIR, jiġu inklużi fil-kamp ta' applikazzjoni tal-SFTR. Dawn il-kuntratti ma jistgħux jiġu rrapportati skont l-EMIR.

#### Kuntratti kumplessi

30. Fil-każ tal-kuntratti li jirriżultaw minn kuntratt ieħor (eż. opzjoni fuq kuntratt tal-futuri), l-ewwel kuntratt jieqaf jeżisti qabel ma jwassal għat-tieni wieħed li huwa materjalment differenti mill-ewwel wieħed. Iż-żewġ kuntratti għandhom jiġu rrapportati b'mod separat, jiġifieri, it-tieni wieħed għandu jiġi rrapportat biss malli l-ewwel kuntratt jiġi terminat. Għalhekk, anki jekk iż-żewġ kuntratti huma konnessi fil-mod li jinholqu, huma għandhom jiġu rrapportati f'żewġ rapporti separati. Fil-każ fejn il-kuntratt li jirriżulta ma jikkwalifikax bħala "derivattiv" jew "kuntratt tad-

derivattiv” kif definit fl-Artikolu 2(5) tal-EMIR, il-kuntratt li jirriżulta m’għandux jiġi rrapportat.

31. Fil-każ fejn derivattiv għandu żewġ komponenti jew iktar (eż. kuntratt tad-derivattiv wieħed li jirrappreżenta strateġija li għandha l-karatteristiċi ta’ diversi kuntratti), il-komponenti kollha tal-kuntratt għandhom jiġu rrapportati f’rapport wieħed, fejn il-kombinament tat-taqsimiet jippermetti dan. Inkella, għandu jiġi ppreżentat rapport għal kull komponent u dawk ir-rapporti għandhom jintrabtu billi jintuża l-istess identifikatur tal-pakkett fit-taqsimi 2.6.

Tranżazzjonijiet tas-suq li ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta’ derivattiv

32. It-tranżazzjonijiet li ġejjin ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta’ derivattiv skont l-EMIR u għalhekk m’għandhomx jiġu rrapportati skont l-EMIR:

- a. Strumenti finanzjarji b’derivattivi inkorporati (eż. bonds konvertibbli): xi strumenti finanzjarji jinħarġu b’karatteristiċi li jistgħu jitqiesu bħala derivattivi inkorporati fl-istruttura tal-istrument innifsu. Dan huwa, pereżempju, il-każ tal-bonds konvertibbli li skont it-Tabella 2.2 tal-Anness III tal-RTS 2017/583 “tfisser strument li jikkonsisti f’bond jew strument ta’ dejn titolizzat b’derivattiv inkorporat, bħal opzjoni li tinxtara l-ekwità sottostanti”.
- b. Prodotti strutturati ta’ finanzjar jew prodotti strutturati huma definiti fl-Artikolu 2(1)(28) tal-MiFIR bħala “dawk it-titoli maħluqa sabiex jittitolizzaw u jittrasferixxu r-riskju ta’ kreditu assoċjat ma’ pula ta’ assi finanzjarji li jintitolaw lid-detentur tat-titoli biex jirċievi flus regolari li jiddependu fuq il-fluss tal-flus mill-assi sottostanti”.
- c. Derivattivi titolizzati huma definiti fit-Tabella 4.1 tal-Anness tal-RTS 2017/583 bħala “titolu trasferibbli kif iddefinit fl-Artikolu 4(1)(44)(c) tad-Direttiva 2014/65/UE differenti mill-prodotti finanzjarji strutturati”. Dawn jinkludu mill-inqas:
  - warrants plain vanilla koperti;
  - ċertifikati ta’ ingranaġġ;
  - warrants eżotiċi koperti;
  - drittijiet negozjabbli;
  - ċertifikati ta’ investiment.

3.2.2 Obbligu ta’ rapportar fir-rigward tal-partijiet involuti fin-negozju.

33. Id-derivattivi intragrupp, li mhumx eliġibbli għall-eżenzjoni, għandhom jiġu rrapportati bħal kwalunkwe derivattiv ieħor u t-taqsimi korrispondenti 2.37 “Intragrupp” għandha timtela b’“Veru”. Madankollu, l-Artikolu 9(1) tal-EMIR jipprevedi eżenzjoni għad-derivattivi intragrupp mill-obbligu ta’ rapportar fejn il-kundizzjonijiet rilevanti jintlaħqu. F’dawn il-każijiet, iż-żewġ kontropartijiet għandhom ikompli jirrapportaw sakemm il-kundizzjonijiet għall-applikazzjoni tal-

eżenzjoni jkunu jistgħu jintlaħqu u l-eżenzjoni tingħata (iktar kjarifiki dwar l-eżenzjoni huma pprovduti fit-taqsima 3.3).

34. Id-derivattivi fi ħdan l-istess entità ġuridika (eż. bejn żewġ uffiċċji jew bejn żewġ fergħat tal-istess entità) m'għandhomx jiġu rrapportati skont l-EMIR peress li ma jinvolvux żewġ kontropartijiet. L-unika eċċezzjoni hija s-sitwazzjoni li fiha l-inadempjenzi ta' Membru tal-Ikklerjar u s-CCP tassumi temporanjament iż-żewġ naħat tal-kuntratti tad-derivattivi pendenti.
35. B'mod simili, is-sussidjarji mhux tal-UE ta' grupp li għalih l-impriża omm hija stabbilita fl-Unjoni mhumix meħtieġa jirrapportaw id-derivattivi tagħhom skont l-EMIR. Fil-każ tal-kuntratti bejn kontroparti tal-UE u kontroparti mhux tal-UE, il-kontroparti tal-UE jeħtieġ li tirrapporta tali kuntratti.
36. L-EMIR jeħtieġ li l-kontropartijiet u s-CCPs jirrapportaw. Is-CCPs huma definiti fl-Artikolu 2(1) tal-EMIR u l-kontropartijiet huma definiti jew bħala FC jekk l-entità taqa' taħt kwalunkwe kategorija ta' kontropartijiet finanzjarji definiti fl-EMIR jew bħala NFC jekk tkun impiża stabbilita fl-Unjoni minbarra CCP jew FC. Il-kunċett ta' impiża mhuwiex definit fl-EMIR. Madankollu, il-Kummissjoni Ewropea tipprovdil fl-FAQ tagħha<sup>15</sup>, fil-mistoqsija II.14, raġunament li jwassal għall-kunsiderazzjoni li l-*"kunċett ta' impiża huwa iktar wiesgħa minn dak ta' "kumpaniji jew ditti" u għalhekk, mhuwiex ristrett għall-entitajiet b'personalità ġuridika jew b'finijiet ta' qligħ (Artikolu 54 tat-TFEU)"*. Ta' min jinnota li l-individwi li mhux qed iwettqu attività ekonomika konsegwentement ma jitqisux bħala impiżi u għalhekk mhumix soġġetti għall-obbligu ta' rapportar skont l-EMIR.
37. Bħala konsegwenza, jekk l-attività mwettqa mill-entità b'natura soċjali jew inkella bi profil mingħajr skop ta' qligħ taqa' taħt id-definizzjoni ta' attività ekonomika li tikkwalifikaha bħala entità soċjali jew mingħajr skop ta' qligħ, hi tkun soġġetta għall-obbligi applikabbli għall-kontropartijiet mhux finanzjarji għad-derivattivi konklużi, inkluż l-obbligu ta' rapportar.
38. Fir-rigward tal-fondi ta' investiment (eż. UCITS, AIF, fondi mhux inkorporati, IORP), il-kontroparti għad-derivattiv huwa ġeneralment il-fond (jew fil-każ tal-fondi umbrella, is-sottofondi). Meta maniġer ta' fond jeżegwixxi kuntratt għal fondi differenti fl-istess ħin (eż. kummerċ ta' blokki), għandu jalloka immedjatament il-parti rilevanti ta' dak il-kuntratt lill-fondi rilevanti u jirrapporta kif xieraq. Bħala konsegwenza, l-ID tal-kontroparti għandha tkun l-ID tal-fond, mhux l-ID tal-maniġer tal-fond. Skont l-Artikoli 9(1b) sa (1d) tal-EMIR, il-maniġer tal-fond għandu jirrapporta d-derivattivi OTC f'isem il-fondi. L-ID tal-maniġer tal-fond għandha tiġi inkluża bħala l-entità responsabbli mir-rapportar u fejn tirrapporta direttament bħala l-entità li tippreżenta rapport. Għandu jiġi nnotat li f'ċirkostanzi rari, il-maniġer tal-fond jeżegwixxi n-negozju f'ismu stess u mhux f'isem il-fondi li jiġġestixxi. F'tali każ, il-kontroparti tkun il-maniġer tal-fond.
39. AIFs mhux tal-UE li jiġu stabbiliti esklussivament għall-iskop li jservu pjan wieħed ta' xiri ta' ishma għall-impjegati jew iktar, jew li huma entitajiet ta' titolizzazzjoni

---

<sup>15</sup> [emir-faqs-10072014\\_en.pdf \(europa.eu\)](#).

b'għan speċjali kif imsemmijin fil-punt (g) tal-Artikolu 2(3) tad-Direttiva 2011/61/UE, ma jikkwalifikawx bħala FCs skont l-Artikolu 2(8) u lanqas bħala NFCs skont l-Artikolu 2(9). Bħala tali, dawn l-AIFs mhumie x soġġetti għall-obbligu ta' rapportar u għalhekk, m'għandhomx jirrapportaw id-derivattivi skont l-EMIR. Madankollu, jekk il-kontroparti l-oħra hija soġġetta għall-obbligu ta' rapportar skont l-EMIR, dik il-kontroparti għandha tirrapporta d-derivattivi konklużi b'tali AIFs mhux tal-UE.

40. B'mod iktar ġenerali, fir-rigward tal-fondi u b'mod partikolari meta AIFM qed jiġġestixxi AIFs domiciljati fl-Unjoni u AIFs domiciljati f'pajjiżi terzi, il-manijer tal-fond għandu jstabbilixxi jekk l-AIF jikkwalifikax bħala FC skont l-Artikolu 2(8) tal-EMIR. Fil-każ li l-AIF jikkwalifika bħala FC, l-AIFM li huwa awtorizzat jew registrat skont l-AIFMD għandu jiżgura li d-dettalji tad-derivattiv jiġu rrapportati.
41. Finalment, xi entitajiet speċifiċi ma jaqgħux fil-kamp ta' applikazzjoni tal-EMIR b'mod ġenerali f'konformità mal-Artikolu 1(4) tal-EMIR bħall-BFI, il-banek ċentrali jew il-korpi pubbliċi responsabbli minn jew li jintervjenu fil-ġestjoni tad-dejn pubbliku għal lista speċifika ta' pajjiżi. Madankollu, fir-rigward tal-Artikolu 1(5), l-obbligu ta' rapportar huwa l-uniku obbligu tal-EMIR li japplika għall-banek multilaterali tal-iżvilupp, għal xi entitajiet tas-settur pubbliku, għall-FSE u għall-MES.
42. Id-ditti tal-investment li jipprovdu servizzi ta' investment (bħall-eżekuzzjoni tal-ordnijiet jew ir-riċevuta u t-trażmissjoni tal-ordnijiet) mingħajr ma jsiru kontroparti għal derivattiv billi jaġixxu bħala prinċipal m'għandhomx obbligu li jirrapportaw skont l-EMIR. Madankollu, fil-każ li d-ditta tal-investment taġixxi bħala manijer tal-fond ta' investment kif deskritt fil-paragrafi 1b, 1c jew 1d tal-Artikolu 9 tal-EMIR, allura din id-ditta tal-investment issir responsabbli u legalment responsabbli mir-rapportar f'isem il-kontroparti u mir-rapportar tal-LEI tagħha stess fil-kamp 1.3 "Entità responsabbli mir-rapportar".
43. B'mod simili, meta kumpanija manijerjali tipprovdi s-servizz tal-ġestjoni tal-portafoll (kif definit fl-Artikolu 4(8) tal-MiFID) lil klijent, u, billi tagħmel hekk, tidhol f'kuntratti tad-derivattivi, il-klijent għandu jitqies bħala l-kontroparti għad-derivattiv, minbarra meta l-kumpanija manijerjali ġorr ir-riskju tal-kuntratt tad-derivattiv u għalhekk titqies bħala kontroparti. Il-kumpanija manijerjali tista' tirrapporta lit-TRs f'isem il-klijenti tagħha mingħajr preġudizzju għar-responsabbiltà tal-klijent li jissodisfa l-obbligu ta' rapportar. F'dik is-sitwazzjoni, l-ID tal-kumpanija manijerjali għandha tiġi pprovduta bħala l-ID tal-entità li tippreżenta r-rapport.
44. Meta sensar ikun kontroparti għal derivattiv, għandu jirrapporta d-derivattiv u jidentifika lilu nnifsu bħala kontroparti. F'konformità mal-RTS dwar ir-rapportar u b'mod partikolari fir-rigward tad-dettalji li għandhom jiġu rrapportati fil-kamp 1.15, is-sensar imbagħad mhuwex meħtieġ jirrapporta l-LEI tiegħu fil-kamp "ID tas-sensar". B'mod alternattiv, jekk sensar jaġixxi biss bħala intermedjarju għall-kontroparti 1, il-LEI tas-sensar għandu jiġi rrapportat fil-kamp "ID tas-sensar".

### 3.2.3 Ir-rapportabbiltà f'xenarji speċifiċi

45. Ir-rapportar skont l-EMIR għandu żewġ naħat, jiġifieri ż-żewġ kontropartijiet għall-kuntratti tad-derivattivi huma meħtieġa jirrapportaw jekk jaqgħu taħt il-kamp ta' applikazzjoni tal-EMIR. Bħala konsegwenza, għal derivattivi konkluż minn żewġ kontropartijiet soġġett għall-EMIR, l-istess derivattiv huwa mistenni li jiġi rrapportat darbtejn, darba f'isem kull kontroparti, u d-dettalji tad-derivattivi irrapportati għandhom ikunu konsistenti fiż-żewġ rapporti.
46. L-Artikolu 9(1e) jistipula li l-kontropartijiet u s-CCPs għandhom jiżguraw li tali dettalji jiġu rrapportati b'mod korrett u mingħajr duplikazzjoni. Abbażi ta' dan ir-rekwiżit, il-kontropartijiet jew entitajiet oħra responsabbli mir-rapportar għandhom jistabbilixxu proċessi u kontrolli sabiex jevitaw ir-riskju ta' rapportar doppju. Dan huwa partikolarment importanti (i) fil-każ ta' bidla tat-TR (żgura li r-rapporti jiddaħħlu fit-TR it-tajjeb), (ii) fil-każ ta' avveniment korporattiv bħal fużjoni jew akkwist (evita li tirrapporta l-istess derivattiv f'isem l-entità l-hażina) jew (iii) fil-każ ta' tibdil fid-delega (żgura li entità delegata waħda biss tirrapporta derivattiv). Fil-każ li rapport doppju jiġi identifikat, il-kontroparti għandha tiegħu azzjonijiet korrettivi immedjatament b'diligenza sabiex issolvi l-problema.
47. Fil-każ ta' novazzjoni, fejn kontroparti (jekk tkun CCP jew kontroparti oħra) tidhol f'derivattiv u ssir kontroparti ġdida għad-derivattiv (dan il-paragrafu ma jkoprix l-avvenimenti ta' kklerjar), id-derivattiv għandu jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u bit-tip ta' event "Intervent" miż-żewġ kontropartijiet, jiġifieri l-kontroparti l-ġdida li tintervjeni kif ukoll il-kontroparti li ma tinbidilx. Għar-rapport oriġinali relatat mad-derivattiv eżistenti, iż-żewġ kontropartijiet għandhom jibagħtu rapport b'tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u b'tip ta' event "Intervent", filwaqt li jimlew l-kamp 2.45 "Data ta' terminazzjoni bikrija".
48. Għall-kummerċ ta' blokki, hemm distinzjoni neċessarja bejn (i) ix-xenarji fejn il-kummerċ ta' blokki ġie konkluż minn ditta ta' investiment u mbagħad allokat lill-klijenti u (ii) dawk ix-xenarji fejn il-kummerċ ta' blokki ġie konkluż minn maniġer ta' fondi mingħajr obbligu ta' rapportar u mbagħad allokat lill-fondi individwali.
49. Fl-ewwel każ, il-kummerċ ta' blokki għandu l-ewwel jiġi rrapportat mid-ditta tal-investment. Id-ditta tal-investment għandha mbagħad tirrapporta l-allokazzjonijiet lill-klijenti individwali.
50. Fit-tieni każ, il-kummerċ ta' blokki li hu sussegwentement allokat lil fondi individwali fid-data tat-tranżazzjoni ma jeħtieġx li jiġi rrapportat. F'tali każijiet, il-kontroparti għad-derivattiv hija l-fond individwali, għalhekk l-allokazzjonijiet għandhom jiġu rrapportati (a) billi jiġi speċifikat il-fond individwali rilevanti (li f'ismu l-maniġer tal-fond daħal fil-kummerċ ta' blokki) bħala l-kontroparti għall-kummerċ imsemmi u (b) billi tiġi speċifikata l-allokazzjoni tal-parti rilevanti tal-kummerċ għall-fond individwali rilevanti. Kwalunkwe parti tal-kummerċ ta' blokki li mhijiex allokata fuq data tat-tranżazzjoni għandha tiġi rrapportata mal-maniġer tal-fond bħala l-kontroparti. Din il-loġika tar-rapportar tkun tapplika biss fejn id-data ta' allokazzjoni ta' wara n-negozjar hija permessa mil-leġiżlazzjoni nazzjonali applikabbli.

51. Fil-każ li ftehim ta' kollateral jippermetti l-kopertura tal-iskoperturi f'tranżazzjonijiet li m'għandhomx jiġu rrapportati skont l-EMIR, il-kollateral irrapportat għandu jkun biss il-kollateral li jkopri l-iskopertura relatata mad-derivattivi rrapportati skont l-EMIR. Jekk huwa impossibbli li fi grupp ta' kollateral jiġi distint l-ammont relatat mad-derivattivi rapportabbli skont l-EMIR mill-ammont relatat ma' tranżazzjonijiet oħra, il-kollateral irrapportat jista' jirrifletti l-kollateral attwali depożitat / riċevut li jkopri grupp iktar wiesgħa ta' tranżazzjonijiet. Bħala konsegwenza, fil-każ li l-ebda mit-tranżazzjonijiet koperti mir-rapport ma tkun tista' tiġi rrapportata skont l-EMIR, l-ebda kollateral m'għandu jiġi rrapportat.
52. Ir-Regolament (UE) 2019/834 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-20 ta' Mejju 2019 li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012 neħħa r-rekwiżit ta' backloading mill-Artikolu 9 tal-EMIR, u għalhekk id-derivattivi konklużi qabel u li m'għandhomx pendenti fit-12 ta' Frar 2014 mhumiex soġġetti għall-obbligu ta' rapportar.
53. Fejn l-ebda kuntratti mhuma konklużi, modifikati jew terminati matul diversi ġranet, l-ebda rapporti mhuma mistennija minbarra aġġornamenti għall-valwazzjonijiet jew għall-kollateral fuq derivattivi pendenti, kif meħtieġ. Peress li wieħed għandu jikkonforma mal-obbligu ta' rapportar sa T+1 (T hija d-data ta' konklużjoni, modifika, terminazzjoni tal-kuntratt), m'hemm l-ebda ħtieġa oħra li jintbagħtu rapporti ta' kuljum jekk m'hemm l-ebda konklużjoni, modifika jew terminazzjoni għall-kuntratt.
54. Id-derivattivi li huma konklużi u mbagħad innettjati jew terminati għal raġunijiet oħra matul l-istess ġurnata, għandhom jiġu rrapportati lit-TRs. Fil-każ ta' terminazzjoni matul l-istess ġurnata, mill-inqas żewġ rapporti għandhom jintbagħtu: rapport b'tip ta' azzjoni "Ġdid" u tieni rapport b'tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u t-tip ta' event rilevanti, sakemm id-derivattiv ikun irrapportat b'tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni" li f'dan il-każ se jiġi nnettjat fil-pożizzjoni sussegwenti (jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 3.7 għal speċifikażjonijiet tar-rapportar fil-livell ta' pożizzjoni).
55. Fir-rigward tad-derivattivi kklerjati, l-Artikolu 2 tal-RTS dwar ir-rapportar jiddettalja kif in-negozji li huma kklerjati għandhom jiġu rrapportati. Bħala konsegwenza, jekk id-derivattiv ma jiġix ikklerjat fl-istess ġurnata minn CCP jew jekk id-derivattiv jiġi konkluż barra miċ-ċentru tan-negozjar, id-derivattiv għandu l-ewwel jiġi rrapportat fl-istat originali tiegħu u mbagħad, malli jiġi kklerjat, id-derivattiv originali għandu jiġi terminat bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Klerjar". Id-derivattiv sussegwenti għandu jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u bit-tip ta' event "Klerjar" jew, jekk rilevanti, bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni".

### 3.3 L-eżenzjoni tal-intragrupp mir-rapportar

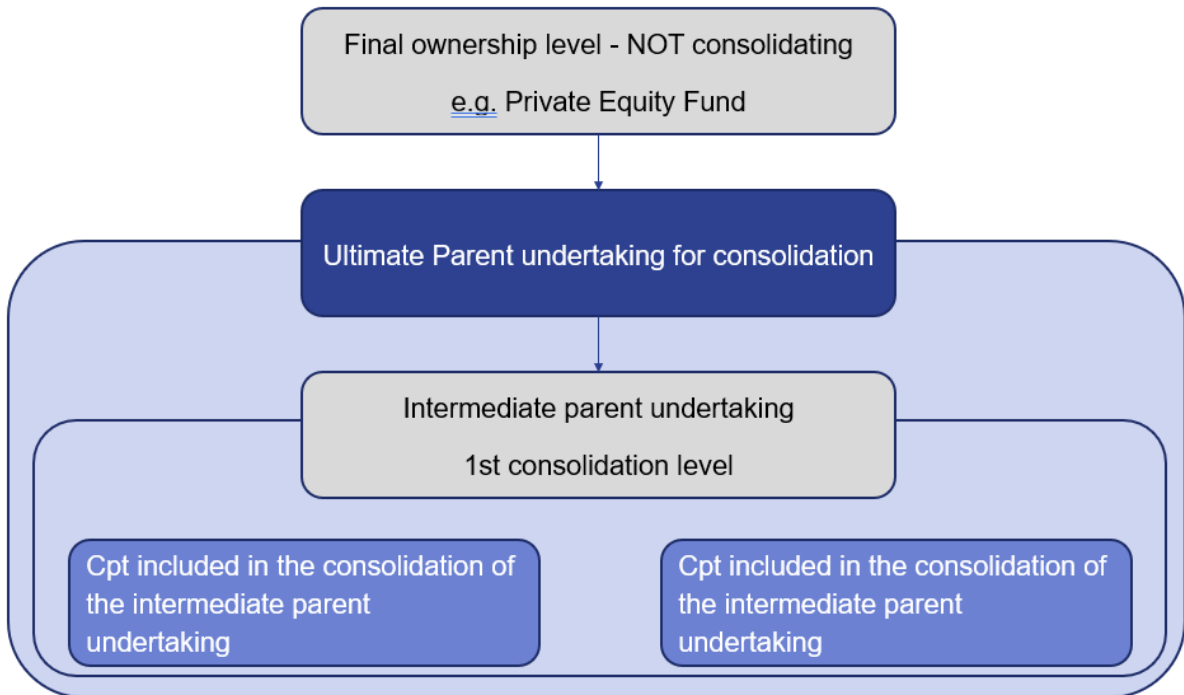
56. Il-perjodu ta' tliet xhur imsemmi fl-Artikolu 9(1) tal-EMIR, kif emendat mir-Regolament 2019/834, li fih l-awtoritajiet jistgħu ma jaqblux mas-sodisfar tal-kundizzjonijiet ta' hawn fuq, jibda fil-jum kalendarju wara r-riċevuta tan-notifika/i mill-ANK rilevanti.

57. L-eżenzjoni għandha tkun valida mid-data meta l-ANK tikkonferma/jikkonfermaw lill-kontropartijiet li l-kundizzjonijiet biex tintuża l-eżenzjoni jintlaħqu, jew jekk l-ebda deċiżjoni ma tiġi notifikata mill-ANK, se tkun valida mill-aħħar tal-perjodu ta' nuqqas ta' oġġezzjoni ta' tliet xhur. Jekk il-kundizzjonijiet, imsemmija fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR, kif emendat mir-Regolament 2019/834, jistgħu ma jibqgħux issodisfati minhabba bidla fil-karatteristiċi tal-kontropartijiet, il-kontropartijiet għandhom jinformaw lill-ANK rilevanti. Mingħajr preġudizzju għall-eżenzjoni eżistenti, l-ANK jistgħu joġġezzjonaw għall-użu tal-eżenzjoni jekk il-kundizzjonijiet ma jkunux għadhom qed jintlaħqu. Mill-mument li fih l-ANK toġġezzjona għall-użu tal-eżenzjoni, l-eżenzjoni ma tkunx valida.
58. Għandu jiġi nnotat li l-kontropartijiet għandhom jirrapportaw id-derivattivi matul il-perjodu ta' tliet xhur sakemm l-ANK ma tinnotifikax/jinnotifikawx il-kontropartijiet li jaqblu mas-sodisfar tal-kundizzjonijiet qabel ma jiskadi l-perjodu ta' tliet xhur.
59. Fir-rigward tar-referenza għall-"impriza omm" għall-iskop tal-kundizzjonijiet għall-eżenzjoni skont l-Artikolu 9(1) tal-EMIR, kif emendat mir-Regolament 2019/834, għandu jitqies li:
- a) l-impriza omm aħħarija tal-grupp<sup>16</sup> rilevanti għall-konsolidament fuq bażi sħiħa hija l-impriza omm għal dak l-iskop, u
  - b) il-proċeduri ta' evalwazzjoni, ta' kejl u ta' kontroll tar-riskju għandhom ikunu applikabbli għall-kontropartijiet li jinnotifikaw l-eżenzjoni mir-rapportar. Mhuwiex neċessarju li jkunu stabbiliti fil-livell tal-grupp sħiħ tal-impriza aħħarija.
60. Il-kunċett tal-impriza omm aħħarija f'punt a) hawn fuq għandu jinftehem bħala l-oġġla entità konsolidanti fil-grupp. L-illustrazzjoni 1 turi l-każ ġenerali.

---

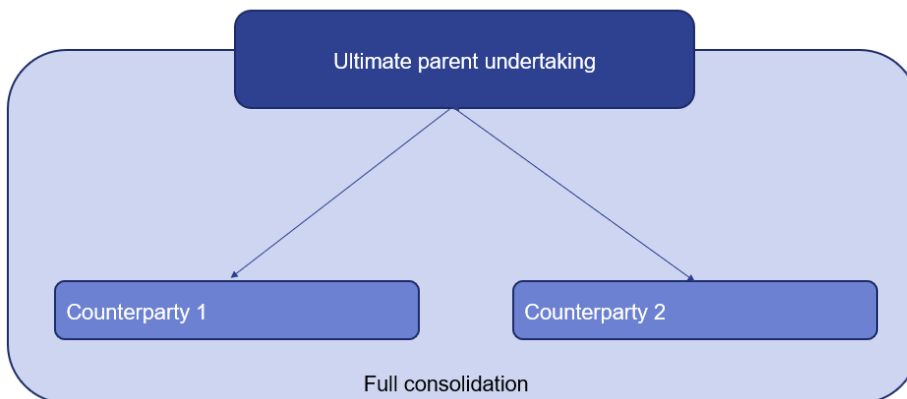
<sup>16</sup> Il-Kummissjoni Ewropea ċċarat li l-eżenzjoni misjuba fl-Artikolu 9(1) tal-EMIR ma tkoprix it-tranżazzjonijiet intragrupp li għalihom l-impriza omm hija stabbilita f'pajjiż terz, anki jekk it-tranżazzjoni ssejtn bejn żewġ kontropartijiet li huma t-tnejn stabbiliti fl-UE. (ara ESMA EMIR Q&A TR Tweġiba 51 (m).)

## ILLUSTRAZZJONI 1: EŻEMPJU TA' STRUTTURA TA' GRUPP B'ŻEWĠ SAFFI

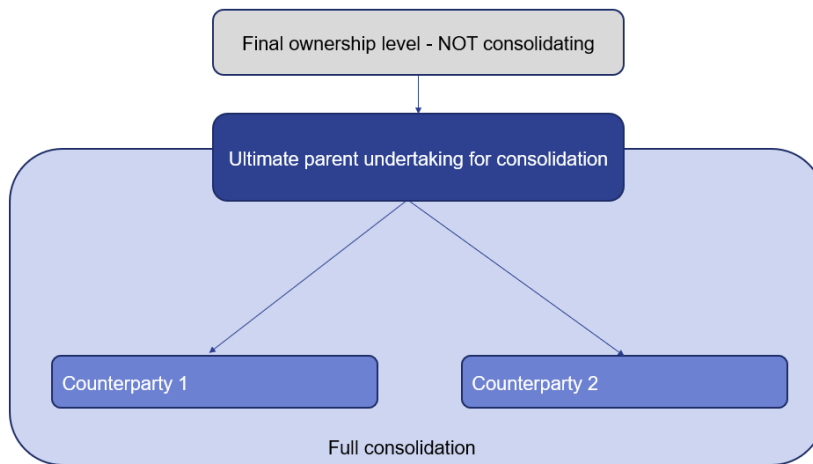


61. Xi każijiet ta' użu speċifiku huma dettaljati fl-Illustrazzjoni 2, fl-Illustrazzjoni 3, fl-Illustrazzjoni 4 u fl-Illustrazzjoni 5.

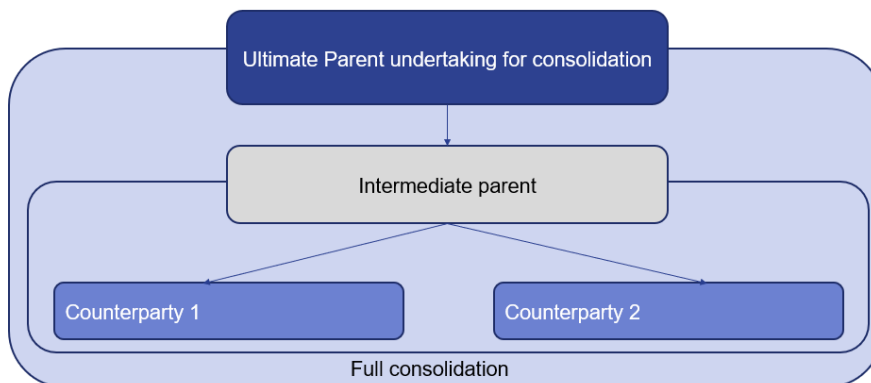
## ILLUSTRAZZJONI 2: KONSOLIDAMENT SHIH MILL-IMPRIŻA OMM AĦĦARIJA



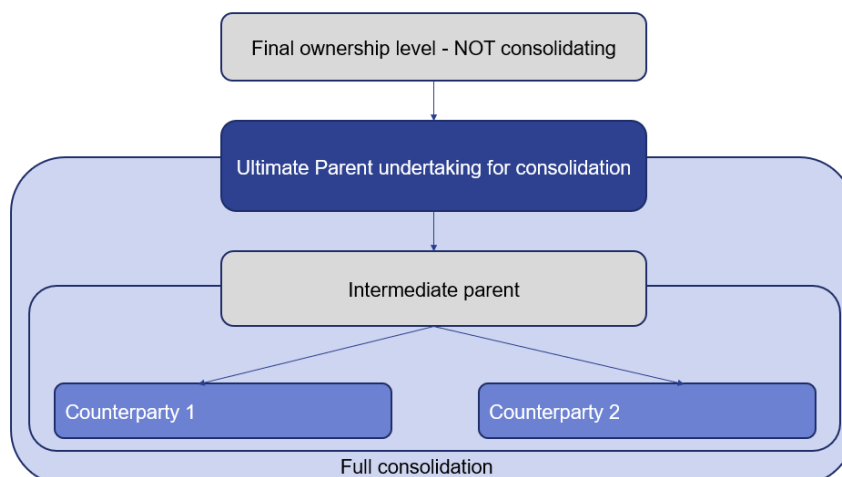
**ILLUSTRAZZJONI 3: KONSOLIDAMENT SHIH MILL-IMPRIŻA OMM AĦĦARIJA MA' ENTITÀ OĦRA LI JKOLLHA S-SJIEDA FINALI**



**ILLUSTRAZZJONI 4: KONSOLIDAMENT SHIH MILL-IMPRIŻA OMM AĦĦARIJA MA' OMM INTERMEDJARJA**



**ILLUSTRAZZJONI 5: KONSOLIDAMENT SHIH MILL-IMPRIŻA OMM AĦĦARIJA MA' OMM INTERMEDJARJA U MA' ENTITÀ OĦRA LI JKOLLHA S-SJIEDA FINALI**



62. Il-kontropartijiet għandhom jipprezentaw in-notifiki tagħhom lill-ANK rispettivi tagħhom (notifiki individwali għandhom jintbagħtu lil kull ANK fejn jinsabu l-kontropartijiet) f'konformità mal-proċeduri adottati minn dawk l-ANK f'kull Stat Membru. Jekk dan huwa aċċettabbli għall-ANK rispettiva, l-impriża omm aħħarija (skont il-paragrafu 59 ta' dawn il-Linji Gwida) jew l-entità rilevanti għall-proċeduri ċentralizzati ta' evalwazzjoni, ta' kejl u ta' kontroll tar-riskju fir-rigward tal-kontropartijiet li għalihom l-eżenzjoni hija nnotifikata tista' tipprovdi notifika waħda li tidentifika kull entità tal-grupp tagħha misjuba f'dak l-Istat Membru li għaliha qed tintalab l-eżenzjoni. Mhuwiex neċessarju li l-impriża omm aħħarija jew l-entità rilevanti għall-proċeduri ċentralizzati ta' evalwazzjoni, ta' kejl u ta' kontroll tar-riskju fir-rigward tal-kontropartijiet li għalihom l-eżenzjoni hija nnotifikata, tkun kontroparti għall-kuntratt tad-derivattiv, u lanqas li tinsab fl-Istat Membru fejn qed tipprezenta notifika.
63. Meta jinnotifikaw bl-intenzjoni tagħhom li japplikaw l-eżenzjoni mill-obbligu ta' rapportar f'konformità mal-Artikolu 9(1) tal-EMIR, il-kontroparti li tinnotifika għandha tiddikjara li tissodisfa l-kundizzjonijiet stabbiliti fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR u, jekk applikabbli, għandha tindika l-ANK l-oħra li ġew notifikati fir-rigward tal-kontroparti(jiet) inkluża/i fin-notifika. L-ANK tista' titlob informazzjoni u/jew dokumenti addizzjonali biex tivvaluta s-sodisfar tal-kundizzjonijiet stabbiliti fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR.
64. Il-kontropartijiet jistgħu jinnotifikaw l-intenzjoni tagħhom biex japplikaw eżenzjoni intragrupp anki jekk il-kontropartijiet ikunu għadhom ma kkonkludewx id-derivattivi u konsegwentement applikaw l-eżenzjoni sakemm waħda mill-ANKs toġġezzjoni għad-derivattivi konkluzi wara li l-eżenzjoni tingħata. Madankollu, in-notifika għandha tiġi pprezentata biss malli l-kundizzjonijiet kollha speċifikati fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR jintlaħqu.
65. Meta l-kontropartijiet tal-istess grupp stabbiliti f'mill-inqas żewġ Stati Membri differenti jinnotifikaw lill-ANK tagħhom bl-intenzjoni tagħhom li japplikaw eżenzjoni mir-rapportar skont l-Artikolu 9(1) tal-EMIR, kull ANK teħtieġ li tqis jekk il-kundizzjonijiet stabbiliti fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) jintlaħqux. L-ANK jistgħu ma jaqblux dwar is-sodisfar ta' dawn il-kundizzjonijiet. Fejn waħda mill-ANK tqis li l-kundizzjonijiet ma jintlaħqux, għandha tinnotifika lill-kontroparti fl-Istat Membru tagħha kif ukoll lill-ANK l-oħra fil-perjodu ta' tliet xhur mir-riċevuta tan-notifika u tispeċifika r-raġunijiet.
66. Fejn il-kontropartijiet iridu jibbenefikaw mill-eżenzjoni mir-rapportar u malli jqisu li indirizzaw l-oġġezzjoni(jiet) imressqa mill-ANK li oġġezzjonaw, għandhom jinnotifikaw mill-ġdid kif xieraq bl-intenzjoni tagħhom li japplikaw l-eżenzjoni mir-rapportar skont l-Artikolu 9(1) tal-EMIR.
67. Kuntratt tad-derivattivi bejn kontroparti finanzjarja (FC) u kontroparti mhux finanzjarja (NFC) fejn:
- a. l-FC tappartjeni kemm għal grupp ta' impriži msemmi fl-Artikolu 3(1) jew fl-Artikolu 80(7) u (8) tad-Direttiva 2006/48/KE (CRD), u grupp ieħor imsemmi fl-Artikoli 1 u 2 tad-Direttiva 83/349/KEE, u

- b. I-NFC tappartjeni biss għall-grupp skont l-Artikoli 1 u 2 tad-Direttiva 83/349/KEE,
  - c. jista' jkun eliġibbli għal eżenzjoni intragrupp mir-rapportar. B'mod partikolari, f'konformità mad-definizzjoni ta' "grupp" fl-Artikolu 2(16) tal-EMIR, kif emendat mir-Regolament 2019/834, tali kuntratt jista' jkun eliġibbli għall-eżenzjoni intragrupp mir-rapportar jekk l-NFC, filwaqt li mhux konsolidat skont is-CRD, ikun parti mill-istess grupp mhux finanzjarju konsolidat bħall-FC.
68. Sabiex jiġi evitat kull dubju, jekk il-kontropartijiet jinnotifikaw lill-ANK rispettivi tagħhom f'dati differenti, għandhom jistennaw sal-aħħar tal-iktar wieħed tard miż-żewġ perjodi ta' tliet xhur qabel ma jistrieħu fuq l-eżenzjoni (sakemm l-ebda ANK m'ogġezzjonat) jew sakemm l-ANK rilevanti kollha jaqblu dwar il-fatt li l-kundizzjonijiet stabbiliti fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR intlaħqu. L-eżenzjoni għar-rapportar għall-kuntratti tad-derivattivi konklużi mill-kontropartijiet rilevanti mhix valida, jekk ANK waħda tkun ogġezzjonat għaliha. Għalhekk, id-derivattivi konklużi bejn il-kontropartijiet, li huma inklużi fin-notifika, għandhom ikompli jiġu rrapportati.
69. Malli l-eżenzjoni mir-rapportar tkun valida, il-kontropartijiet li jibbenefikaw mill-eżenzjoni għandhom jibagħtu r-rapporti bit-tip ta' azzjoni "Żball" għad-derivattivi kollha msemmija fil-paragrafi 2(a) u 2(b) tal-Artikolu 2 tal-ITS dwar ir-rapportar bil-kontropartijiet li għalihom l-eżenzjoni mir-rapportar tkun valida.
70. Jekk l-eżenzjoni mir-rapportar ma baqgħetx valida minħabba nuqqas ta' konformità ma' kwalunkwe mill-kundizzjonijiet imsemmija fit-tielet subparagrafu tal-Artikolu 9(1) tal-EMIR, il-kontropartijiet ikkonċernati għandhom jirrapportaw il-kuntratti tad-derivattivi li ġew konklużi u li ma ġewx itterminati jew immaturati mill-kontropartijiet fid-data li l-eżenzjoni ma baqgħetx valida billi jużaw it-tip ta' azzjoni "Ġdid" u t-tip ta' event "Kummerċ" u jipprovdu d-dettalji rilevanti kollha ta' dawk id-derivattivi kif ikunu fid-data meta l-eżenzjoni ma baqgħetx valida, u jirrapportaw l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja sussegwenti kollha kif iseħħu. Mhuwix neċessarju li l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja jiġu rrapportati lid-derivattivi li seħħ bejn id-data tal-konklużjoni ta' dak id-derivattiv u d-data meta l-eżenzjoni ma baqgħetx valida. Jekk dawn id-derivattivi ġew ikkanċellati preċedement bit-tip ta' azzjoni "Żball" fil-mument li ngħatat l-eżenzjoni, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw tali derivattivi bit-tip ta' azzjoni Ftuh mill-ġdid. Anki f'dan ix-xenarju, mhuwix neċessarju li jiġu rrapportati l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja li seħħew matul il-perjodu meta l-eżenzjoni mir-rapportar kienet valida.

### 3.4 L-allokazzjoni tar-responsabbiltà għar-rapportar

#### 3.4.1 Kjarifiki ġenerali

71. F'konformità mal-Artikolu 9(1) tal-EMIR, il-kontropartijiet u s-CCPs huma meħtieġa jiżguraw li d-dettalji ta' kwalunkwe derivattiv li jista' jiġi rrapportat kif deskritti fit-taqsim 3.2 jiġu rrapportati lil TR. Għalhekk, sakemm ma tkunx tapplika eżenzjoni jew sakemm parti differenti ma tkunx responsabbli u legalment responsabbli mir-

rapportar skont l-Artikolu 9(1a) tal-EMIR, l-obbligi ta' rapportar japplikaw għall-kontropartijiet u għas-CCPs kollha stabbiliti fl-Unjoni malli jidhlu f'kuntratt tad-derivattiv. Dan ifisser li derivattiv bħal dan għandu jiġi rrapportat mhux iktar tard mill-għurnata ta' xogħol wara l-konklużjoni, il-modifika jew it-terminazzjoni tiegħu.

### 3.4.2 Il-kummerċ tal-FC ma' NFC

72. Fir-rigward tad-dispożizzjonijiet skont l-Artikolu 9(2) tal-ITS dwar ir-rapportar, l-ESMA tqis li, sabiex jiġu ssodisfati r-rekwiżiti rispettivi, l-NFC- u l-FC għandhom jaqblu dwar il-mod kif jiskambjaw l-informazzjoni f'dawn il-każijiet kollha. B'mod partikolari, fir-rigward tal-Artikolu 9(2)(a) tal-ITS dwar ir-rapportar, daww l-arranġamenti għandhom jippermettu lill-FC jkollha l-informazzjoni mhux iktar tard minn T+1 wara l-konklużjoni jew il-modifika ta' kuntratt sabiex l-FC tkun tista' tipproċedi bir-rapportar f'waqtu. Dan jista' jinkiseb eż. billi tiġi pprovduta lista ta' valuri standard predefiniti li għandhom jintużaw bħala awtomatiċi mill-FC, sakemm ma jiġix speċifikat mod ieħor mill-NFC-. Fi kwalunkwe każ, l-NFC- tibqa' responsabbli biex tipprovdli lill-FC d-dettalji korretti u l-FC hija responsabbli li tuża l-informazzjoni pprovduta mill-NFC-. Bħala eżempju ta' valuri predefiniti se nikkunsidraw il-każ fejn NFC- qed tidhol f'kuntratti tad-derivattivi ma' istituzzjoni ta' kreditu mingħajr l-użu ta' sensar, billi ma tikklerjax daww il-kuntratti u tidhol għalihom biss biex tiġi għajja l-attività kummerċjali tagħha fis-sens tal-Artikolu 10(3) tal-EMIR. F'dan il-każ, l-NFC- tista' taqbel li l-FC tirrapporta l-valuri predefiniti ta' hawn taht fil-kampijiet speċifikati fl-Artikolu 9(2) tal-ITS dwar ir-rapportar, sakemm l-NFC- ma tagħtix struzzjonijiet speċifiċi oħra lill-FC:
- a. 1.15 "ID tas-sensar": vojta.
  - b. 1.16 "Membru tal-Ikklerjar": vojta.
  - c. 1.20 "B'rabta diretta ma' attività kummerċjali jew finanzjament tat-teżor": "Veru".
73. L-ESMA tiegħu din l-opportunità biex tfakkar lill-parteciċipanti tas-suq li l-NFC- mhumix meħtieġa jirrapportaw id-data dwar il-kollateral, il-metodu ta' valwazzjoni skont is-suq, jew il-valwazzjonijiet skont mudell tal-kuntratti f'konformità mal-Artikolu 4 tal-RTS dwar ir-rapportar. Madankollu, jekk l-FC tirrapporta din l-informazzjoni, għandha tkun korretta mill-kronogramma tal-kollateral jew tal-valwazzjoni rispettiva.
74. Sitwazzjoni partikolari hi meta konklużjoni ta' derivattiv tkun għet irrapportata jew kellha tkun irrapportata mill-NFC- (għax twettqet qabel ma d-dispożizzjonijiet li jistabbilixxu r-responsabbiltà ta' rapportar saru applikabbli fit-18 ta' Ġunju 2020 jew għax l-NFC- għażlet li tibqa' barra fil-hin tal-eżekuzzjoni), u modifika jew terminazzjoni għandha tiġi rrapportata skont id-dispożizzjonijiet li jattribwixxu r-responsabbiltà u r-responsabbiltà legali lill-FC. B'mod partikolari, din is-sitwazzjoni tista' sseħħ matul il-perjodu ta' tranżizzjoni, u għalhekk skont il-prinċipji spjegati fit-taqsima 3.1 dwar it-tranżizzjoni għall-istandards ta' rapportar godda. L-ESMA tqis ukoll li l-arranġamenti bejn l-NFC- u l-FC għandhom iqisu tali sitwazzjonijiet sabiex jiżguraw il-kontinwità tar-rapportar f'termini ta' kontenut, puntwalità u adeguatezza.

Il-kontropartijiet għandhom jiżguraw ukoll li daww il-kuntratti ma' jiġux irrapportati b'duplikazzjoni.

75. Għal kwalunkwe derivattivi OTC pendenti fejn FC u NFC- jirrapportaw lil żewġ Repożitorji tad-Data dwar it-Tranżazzjonijiet differenti fil-mument li r-responsabbiltà u r-responsabbiltà legali jiġu trasferiti, id-derivattivi OTC pendenti tal-NFC- għandhom jiġu ttrasferiti lit-TR tal-FC f'dak il-mument, sakemm l-FC ma tiddeċidix li ssir klijent tat-TR tal-NFC- u tirrapporta d-derivattivi OTC konklużi mal-NFC- lil dak it-TR. B'mod simili, kull darba li NFC tibdel l-istatus tagħha minn NFC- għal NFC+, u għalhekk ir-responsabbiltà u r-responsabbiltà legali tiġi trasferita lill-NFC, id-derivattivi OTC pendenti konklużi mal-FC għandhom jiġu trasferiti lit-TR tal-NFC, sakemm l-NFC ma tiddeċidix li ssir klijent tat-TR tal-FC u tirrapporta d-derivattivi OTC konklużi mal-FC lil dak it-TR. Kwalunkwe trasferiment bħal dan ta' derivattivi OTC bejn it-TRs ta' kwalunkwe par ta' FC-NFC għandu jittwettag skont il-Linji Gwida dwar it-trasferiment tad-data bejn ir-Repożitorji tad-Data dwar it-Tranżazzjonijiet <sup>17</sup> (b'mod partikolari, id-derivattivi soġġetti għat-trasferiment m'għandhomx jiġu kkanċellati u rrapportati mill-ġdid mill-kontropartijiet, iżda pjuttost trasferiti kif speċifikat fil-Linji Gwida).
76. Fir-rigward tal-Artikolu 9(2)(b) tal-ITS dwar ir-rapportar, il-kampijiet 1.7 "Livell limitu għall-ikklerjar tal-kontroparti 1" u 1.13 "Livell limitu għall-ikklerjar tal-kontroparti 2" huma parti mid-dettalji li jistgħu jiġu rrapportati. Sa fejn possibbli, l-NFC- għandha tinforma lill-FC dwar bidla antiċipata fl-istatus tagħha qabel id-data tal-kalkolu annwali meħtieġ tal-pożizzjonijiet tagħha skont l-Artikolu 10(1) tal-EMIR sabiex jiġi evitat kwalunkwe tfixkil fil-kontinwità tar-rapportar. Filwaqt li l-istatus tal-NFC huwa magħruf u vvalutat primarjament mill-NFC innifisha, l-FC għandha tiġbor l-informazzjoni fuq bażi regolari sabiex tkun tista' twettaq ir-rapportar tagħha stess. Meta l-FC tinduna b'bidla minn NFC+ għal NFC- wara d-data tal-kalkolu, għandha tippreżenta r-rapporti neqsin relatati mad-derivattivi OTC li kienu konklużi, modifikati jew terminati wara dik id-data mingħajr dewmien bla bżonn. Tali sottomissjonijiet għandhom isiru, malli d-dettalji kollha rilevanti jiġu riċevuti mill-NFC (skont l-Artikolu 9(2)(a) tal-ITS dwar ir-rapportar) dwar dawn id-derivattivi.
77. B'mod simili, l-NFC għandha tiegħu l-passi kollha rilevanti sabiex tiżgura li hi kapaċi tiegħu l-kontroll tar-rapportar malli tibdel l-istatus tagħha minn NFC- għal NFC+ sabiex tiżgura l-kontinwità tar-rapportar f'termini ta' kontenut, puntwalità u adegwatezza. Dan jinkludi wkoll li l-NFC għandha tinforma lill-FC malajr kemm jista' jkun u għalhekk, l-NFC għandha idealment tantiċipa l-bidla.
78. Fir-rigward tal-Artikolu 9(2)(c) tal-ITS dwar ir-rapportar, l-NFCs huma responsabbli mill-iżgurar li l-LEI tagħhom tiġi mġedda f'waqtha. Sabiex jiġi evitat tfixkil fir-rapportar u biex l-FC tevita li jkollha tiġġestixxi r-rifjuti mit-TRs, l-ESMA tqis li FC tista' eż. tikkordina fi żmien xieraq mal-NFC- sabiex din tal-aħħar iġġedded l-LEI tagħha. Madankollu, jekk l-NFC- ma tkunx ġeddet fi żmien xieraq l-LEI tagħha u għalhekk l-FC ma setgħetx tirrapporta b'suċċess f'isem l-NFC-, l-FC għandha

<sup>17</sup>

[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-2351\\_final\\_report\\_-\\_guidelines\\_on\\_data\\_transfer\\_between\\_trade\\_repositories\\_emir\\_sfr.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-2351_final_report_-_guidelines_on_data_transfer_between_trade_repositories_emir_sfr.pdf)

tippreżenta r-rapporti neqsin mingħajr dewmien mingħajr bżonn malli I-LEI tal-NFC- jiġġedded.

79. Filwaqt li l-obbligu ta' rapportar tad-derivattivi OTC m'għadux tal-NFC-, l-ESMA tqis li hija ta' importanza kbira li ż-żewġ kontropartijiet, inkluż l-NFC-, ikunu fil-pussess ta' informazzjoni kompleta u aġġornata dwar id-dettalji tad-derivattivi li ġew irrapportati lil TR. Għalhekk, l-ESMA tqis li l-FCs jistgħu eż. jipprovdur lill-kontropartijiet NFC- tagħha fuq bażi regolari (eż. fix-xahar) informazzjoni dwar il-kuntratti li huma pendenti fit-TRs. Jekk l-NFC- tkun tista' tqabbel ir-rekords tagħha stess mar-rekords tad-derivattivi maħżuna fit-TRs fuq bażi regolari, dan jappoġġja fit-twettiq tal-obbligi l-oħra tagħha kif definiti skont l-EMIR u b'mod iktar partikolari l-Artikolu 9(2) tal-EMIR "Il-kontropartijiet għandhom iżommu rekord ta' kwalunkwe kuntratt tad-derivati li jkunu kkonkludew u kwalunkwe modifika mill-inqas għal f'ames snin wara t-terminazzjoni tal-kuntratt" u regolamenti oħra rilevanti kif ukoll biex tkun konxja tal-informazzjoni disponibbli għall-entitajiet elenkati fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR f'isimhom.
80. Sabiex jiġi evitat kull dubju, l-ESMA terġa' tisħaq li l-kjarifiki kollha msemmija qabel japplikaw biss għad-derivattivi OTC. Għalhekk, għall-ETDs, jiġifieri kwalunkwe kuntratt tad-derivattiv li ma jikkwalifikax bħala OTC abbażi tad-definizzjoni tal-Artikolu 2(7) tal-EMIR kif emendat mill-Artikolu 32 tal-SFTR, il-kontroparti tibqa' responsabbli u legalment responsabbli li tirrapporta d-dettalji lil TR u d-dispożizzjonijiet relatati mat-trasferiment tar-responsabbiltà u tar-responsabbiltà legali ma japplikawx. Il-kontropartijiet ma jistgħux jassumu li l-opzjonijiet u l-kuntratti tal-futuri nnegożjati fiċ-ċentru tan-negożjar huma ETDs.
81. F'każijiet verament speċifiċi, ċirkostanzi esterni jistgħu jwasslu għal bidla fl-allokazzjoni tar-responsabbiltà għar-rapportar eż.:
- a. FC li kienet stabbilita f'pajjiż taż-ŻEE se tkun stabbilita f'pajjiż terz,
  - b. Tibdil fil-kuntratt tad-derivattiv minn OTC għal ETD jew viċi versa.
82. F'tali każijiet, l-ESMA tqis li l-allokazzjoni tar-responsabbiltà tiddependi mis-sitwazzjoni kull darba li jqum rekwiżit ta' rapportar, eż. għal kuntratt tad-derivattiv li huwa meqjus OT sal-30/11 u jsir ETD mill-1/12, l-FC hija responsabbli mir-rapportar sat-30/11 inkluż matul li l-NFC- se ssir responsabbli u legalment responsabbli mir-rapportar mill-1/12. Id-dispożizzjonijiet kollha l-oħra ta' dawn il-linji gwida se jkunu applikabbli f'konformità mal-allokazzjoni tar-responsabbiltà.
83. Limitu ieħor hu li d-dispożizzjonijiet dwar l-allokazzjoni tar-responsabbiltà japplikaw biss meta l-FC tkun stabbilita fl-Unjoni jew fejn il-kundizzjonijiet stabbiliti fir-raba' subparagrafu tal-Artikolu 9(1a) tal-EMIR jintlaħqu.
84. Finalment, il-kontropartijiet għandhom iqisu s-sitwazzjoni tal-implimentazzjoni tal-emendi għall-EMIR fil-pajjiżi ŻEE (l-Iżlanda, il-Liechtenstein u n-Norveġja). Sakemm l-emendi għall-EMIR jiġu inkorporati fil-ftehim ŻEE u trasposti fil-liġijiet nazzjonali ta' dawn il-pajjiżi, il-kontropartijiet għandhom jivvalutaw b'attenzjoni l-obbligi tagħhom meta jkunu qed jinnegożjaw ma' kontropartijiet taż-ŻEE u jkollhom arrangamenti fis-seħh biex jiżguraw li r-rapporti jsiru mingħajr duplikazzjoni.

**Tabella 2 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| Xenarju                                                                                                                            |             | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2) | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| FC li tirrapporta f'isem NFC- f'konformità mal-Artikolu 9(1a)                                                                      | Komponent 1 | LEI FC                                   | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC-                 |
|                                                                                                                                    | Komponent 2 | LEI FC                                   | LEI FC                                       | LEI NFC-                 | LEI FC                   |
| FC li tirrapporta f'isem NFC- f'konformità mal-Artikolu 9(1a) u FC li tiddelega lill-RSE                                           | Komponent 1 | LEI RSE                                  | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC-                 |
|                                                                                                                                    | Komponent 2 | LEI RSE                                  | LEI FC                                       | LEI NFC-                 | LEI FC                   |
| NFC- li toħroġ minn FC li tirrapporta f'isimha f'konformità mal-Artikolu 9(1a)                                                     | Komponent 1 | LEI FC                                   | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC-                 |
|                                                                                                                                    | Komponent 2 | LEI NFC-                                 | LEI NFC-                                     | LEI NFC-                 | LEI FC                   |
| NFC- li toħroġ minn FC li tirrapporta f'isimha f'konformità mal-Artikolu 9(1a) FC li tiddelega lill-RSE NFC- li tiddelega lill-RSE | Komponent 1 | LEI RSE                                  | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC-                 |
|                                                                                                                                    | Komponent 2 | LEI RSE2                                 | LEI NFC-                                     | LEI NFC-                 | LEI FC                   |

**Tabella 2 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| Xenarju                                                                                         |                                              | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2) | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9)                                                  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| NFC+ li tiddelega lill-FC                                                                       | Komponent 1                                  | LEI FC                                   | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC+                                                                  |
|                                                                                                 | Komponent 2                                  | LEI FC                                   | LEI NFC+                                     | LEI NFC+                 | LEI FC                                                                    |
| NFC+ li tiddelega lill-FC u FC li tissottodelega lill-RSE                                       | Komponent 1                                  | LEI RSE                                  | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC+                                                                  |
|                                                                                                 | Komponent 2                                  | LEI RSE                                  | LEI NFC+                                     | LEI NFC+                 | LEI FC                                                                    |
| NFC+ li ma tiddelegax lill-FC                                                                   | Komponent 1                                  | LEI FC <sup>18</sup>                     | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC+                                                                  |
|                                                                                                 | Komponent 2                                  | LEI NFC+ <sup>19</sup>                   | LEI NFC+                                     | LEI NFC+                 | LEI FC                                                                    |
| Kontroparti li tinnegozja ma' persuna naturali li mhux eliġibbli għal LEI li tiddelega lill-RSE | Komponent 1                                  | LEI RSE                                  | LEI CP 1                                     | LEI CP 1                 | Kodiċi tal-klijent kif speċifikat fl-ITS dwar ir-rapportar għall-kamp 1.9 |
|                                                                                                 | L-ebda rapportar tal-Komponent 2 mhu meħtieġ |                                          |                                              |                          |                                                                           |
| Il-kuntratt huwa ETD<br><br>(L-ebda delega oħra mhi stabbilita <sup>20</sup> )                  | Komponent 1                                  | LEI FC                                   | LEI FC                                       | LEI FC                   | LEI NFC-                                                                  |
|                                                                                                 | Komponent 2                                  | LEI NFC-                                 | LEI NFC-                                     | LEI NFC-                 | LEI FC                                                                    |

<sup>18</sup> Jekk l-FC tistrieħ fuq entità oħra biex tippreżenta r-rapporti f'isimha, il-kamp għandu jimtela bl-LEI ta' dik l-RSE.

<sup>19</sup> Jekk l-NFC+ tistrieħ fuq entità oħra biex tippreżenta r-rapporti f'isimha, il-kamp għandu jimtela bl-LEI ta' dik l-RSE.

<sup>20</sup> Fil-każ li ssir delega għal RSE oħra, il-logika hija l-istess bħal meta d-delega ssir fil-każ ta' NFC- li tohrog minn FC li tirrapporta f'konformità mal-Artikolu 9(1a).

**Tabella 2 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| Xenarju                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9) |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| <p><b>Xenarju kumpless b'diversi avvenimenti:</b></p> <p><b>NFC+ li tiddelega r-rapportar lill-RSE.</b></p> <p><b>NFC+ ssir NFC- u tiddeċiedi li toħroġ minn FC li tirrapporta f'isimha f'konformità mal-Artikolu 9(1a) iżda li tistrieħ fuq l-RSE.</b></p> <p><b>NFC- tiddeċiedi li tipparteċipa jgħifieri li tieqaf tiddelega lill-RSE u li tibda tistrieħ fuq FC f'konformità mal-Artikolu 9(1a).</b></p> <p><b>L-FC tuża TR ieħor mill-RSE.</b></p> <p><b>NFC- tingħaqad ma' NFC oħra (immarkata NFC*) li tibqa' NFC-.</b></p> <p><b>NFC- issir NFC+.</b></p> <p><b>F'dan ix-xenarju niffukaw biss fuq il-Komponent irrapportat f'isem l-NFC.</b></p> |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                              |                          |                          |
| <b>1. NFC+ li tiddelega r-rapportar lil RSE</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | LEI RSE                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | LEI NFC                                      | LEI NFC                  | LEI FC                   |
| <b>2. NFC+ issir NFC- iżda toħroġ mill-FC li tirrapporta f'isimha skont l-Artikolu 9(1a) u tiddeċiedi li tkompli d-delega lil RSE</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p><i>L-NFC tinnotifika lill-FC qabel il-bidla tal-istatus abbażi tal-kalkolu annwali.</i></p> <p><i>L-NFC tinnotifika lill-FC ukoll li hi qed tiddeċiedi li ma tapplikax it-trasferiment tar-responsabbiltà u tar-responsabbiltà legali f'konformità mal-Artikolu 9(1a).</i></p> <p><i>L-NFC tkompli tistrieħ fuq il-proċess attwali tagħha u tiddelega b'mod volontarju lill-RSE tagħha.</i></p> |                                              |                          |                          |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | LEI RSE                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | LEI NFC                                      | LEI NFC                  | LEI FC                   |
| <b>3. NFC- tipparteċipa fir-rapportar mill-FC f'isimha skont l-Artikolu 9(1a)</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p><i>Qabel id-delega, l-NFC tinnotifika lill-FC li għandha l-intenzjoni li tipparteċipa fir-reġim previst skont l-Artikolu 9(1a) u li tittrasferixxi r-responsabbiltà u r-responsabbiltà legali għar-rapportar lill-FC f'konformità mal-Artikolu 9(1a) mill-inqas 10 ijiem qabel it-trasferiment tar-responsabbiltà.</i></p>                                                                      |                                              |                          |                          |

**Tabella 2 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| Xenarju                                                   | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2)                                                                                                                                                                                                                          | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9) |
|-----------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                                                           | <i>L-FC u l-NFC jimplimentaw l-arrangamenti meħtieġa skont l-Artikolu 9(2) tal-ITS dwar ir-rapportar.</i>                                                                                                                                                         |                                              |                          |                          |
|                                                           | <i>Bħala prekontidizzjoni għat-trasferiment attwali tar-responsabbiltà, l-NFC tibda u twettaq it-trasferiment tad-data mit-TR tal-RSE tagħha għat-TR tal-FC f'konformità mal-Linji Gwida dwar it-trasferiment tad-data bejn it-TRs u ma' dawn il-Linji Gwida.</i> |                                              |                          |                          |
|                                                           | LEI FC                                                                                                                                                                                                                                                            | LEI FC                                       | LEI NFC                  | LEI FC                   |
| <b>4. L-NFC- tingħaqad ma' NFC- oħra (immarkata NFC*)</b> | <i>L-FC jew l-NFC- issegwi l-proċess deskritt fl-Artikolu 8 tal-ITS dwar ir-rapportar relatat mat-tibdil tal-LEI. Malli l-bidla tiġi pproċessata mit-TR, l-LEI l-gdid għandu jintuża.</i>                                                                         |                                              |                          |                          |
|                                                           | LEI FC                                                                                                                                                                                                                                                            | LEI FC                                       | LEI NFC*                 | LEI FC                   |
| <b>5. NFC- issir NFC+</b>                                 | <i>L-NFC tinnotifika lill-FC qabel il-bidla tal-istatus abbażi tal-kalkolu annwali.</i>                                                                                                                                                                           |                                              |                          |                          |
|                                                           | <i>F'konformità mal-arrangamenti stabbiliti bejn iż-żewġ kontropartijiet u meħtieġa skont l-Artikolu 9(2) tal-ITS dwar ir-rapportar, l-NFC tinnotifika lill-FC bil-bidla tal-istatus abbażi tal-kalkolu annwali.</i>                                              |                                              |                          |                          |
|                                                           | <i>Jekk meħtieġ skont l-arrangamenti, l-FC jew l-NFC tibda u twettaq it-trasferiment tad-data mit-TR tagħha għat-TR tal-NFC f'konformità mal-Linji Gwida dwar it-trasferiment tad-data bejn it-TRs u ma' dawn il-Linji Gwida.</i>                                 |                                              |                          |                          |
|                                                           | LEI NFC*                                                                                                                                                                                                                                                          | LEI NFC*                                     | LEI NFC*                 | LEI FC                   |

### 3.4.3 CCP

85. Fir-rigward tas-CCPs, fl-EMIR is-CCPs mhumix meqjusa bħala Kontropartijiet Finanzjarji skont l-Artikolu 2(8) tal-EMIR, u għalhekk jekk NFC- tidhol direttament f'kuntratt tad-derivattiv ma' CCP, is-CCP ma ssirx responsabbli u legalment responsabbli mir-rapportar tad-dettalji tad-derivattiv f'isem l-NFC-. F'tali każijiet, l-obbligu ta' konformità mal-obbligu ta' rapportar jibqa' għand l-NFC-.

### 3.4.4 Fondi (UCITS, AIF u IORP li, f'konformità mal-liġi nazzjonali, m'għandhomx personalità ġuridika)

86. L-Artikoli 9(1b), (1c) u (1d) jintroduċu wkoll l-allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar għall-fondi lejn il-manijer tal-fond rispettiv tagħhom f'ċerti ċirkostanzi. F'dawn il-każijiet, huwa meqjus li l-manijers tal-fond għandhom id-dettalji kollha rilevanti disponibbli fir-rwoli rispettivi tagħhom u li l-konformità mad-dispożizzjonijiet dwar l-allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar tista' tiġi żgurata f'konformità mar-regolament.
87. Bħala illustrazzjoni, jekk jogħġbok irreferi għat-Tabella 3 hawn taħt.

**Tabella 3 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| <i>Xenarju</i>                                                                                                 |                    | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2) | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9) |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Kumpanija manijerjali / AIFM (IFM) li tirrapporta f'isem il-fond skont l-Artikolu 9(1c)                        | <i>Komponent 1</i> | <i>LEI IFM</i>                           | <i>LEI IFM</i>                               | <i>LEI fond</i>          | <i>LEI CPT</i>           |
|                                                                                                                | <i>Komponent 2</i> | <i>LEI CPT</i>                           | <i>LEI CPT</i>                               | <i>LEI CPT</i>           | <i>LEI fond</i>          |
| Kumpanija Manijerjali / AIFM (IFM) li tirrapporta f'isem il-fond skont l-Artikolu 9(1c) u li tiddelega lis-CPT | <i>Komponent 1</i> | <i>LEI CPT</i>                           | <i>LEI IFM</i>                               | <i>LEI fond</i>          | <i>LEI CPT</i>           |
|                                                                                                                | <i>Komponent 2</i> | <i>LEI CPT</i>                           | <i>LEI CPT</i>                               | <i>LEI CPT</i>           | <i>LEI fond</i>          |
| Kumpanija Manijerjali / AIFM (IFM) li tirrapporta f'isem il-fond skont l-Artikolu 9(1c) u                      | <i>Komponent 1</i> | <i>LEI RSE</i>                           | <i>LEI IFM</i>                               | <i>LEI fond</i>          | <i>LEI CPT</i>           |
|                                                                                                                | <i>Komponent 2</i> | <i>LEI CPT</i>                           | <i>LEI CPT</i>                               | <i>LEI CPT</i>           | <i>LEI fond</i>          |

**Tabella 3 - Mili tal-kampijiet relatati mal-kontropartijiet, mal-entità li tippreżenta rapport u mal-entità responsabbli mir-rapportar**

| <i>Xenarju</i>        | Entità li tippreżenta rapport (kamp 1.2) | Entità responsabbli mir-rapportar (kamp 1.3) | Kontroparti 1 (kamp 1.4) | Kontroparti 2 (kamp 1.9) |
|-----------------------|------------------------------------------|----------------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| li tiddelega lill-RSE |                                          |                                              |                          |                          |

88. Fil-każ partikolari fejn fond li jikkwalifika bħala FC jidhol f'derivattiv OTC ma' NFC-, id-dispożizzjoni dwar l-allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar fl-Artikolu 9(1) u l-kjarifiki tagħha fil-Linji Gwida relatati skont it-taqsima 3.4.2 hawn fuq japplikaw għad-derivattiv OTC min-naħa tal-kontroparti. Għalhekk, f'sitwazzjoni bħal din:
- Il-manijer tal-fond huwa responsabbli u legalment responsabbli li jirrapporta d-derivattiv OTC f'isem il-fond;
  - Il-fond huwa responsabbli u legalment responsabbli li jirrapporta d-derivattiv OTC f'isem l-NFC-.
89. Bħala illustrazzjoni, jekk AIF (LEI AAAAAAAAAA1111111111) ma' AIFM (LEI AAAAAAAAAA2222222222) jidhol f'kuntratt tad-derivattiv OTC ma' NFC- (LEI 123456789ABCDEFGHIJK), il-kampijiet relatati mal-kontroparti għandhom jimtlew kif ġej:

| TABELLA 4 – EŻEMPJU TA' FOND RESPONSABBLI LI JIRRAPPORTA D-DERIVATTIV F'ISEM L-NFC- |                                   |                                   |  |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|--|
| Rapport 1 tad-derivattiv                                                            |                                   | Rapport 2 tad-derivattiv          |  |
| 1.3 Entità Responsabbli mir-Rapportar                                               | LEI AIFM:<br>AAAAAAAAAA2222222222 | LEI AIF:<br>AAAAAAAAAA1111111111  |  |
| 1.4 Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)                                      | LEI AIF:<br>AAAAAAAAAA1111111111  | LEI NFC-:<br>123456789ABCDEFGHIJK |  |
| 1.9 Kontroparti 2                                                                   | LEI NFC-:<br>123456789ABCDEFGHIJK | LEI AIF:<br>AAAAAAAAAA1111111111  |  |

90. Sabiex jiġi evitat kull dubju, l-ESMA terġa' tişhaq li l-kjarifiki kollha msemija qabel japplikaw biss għad-derivattivi OTC. Għalhekk, għall-ETDs, jiġifieri kwalunkwe kuntratt tad-derivattiv li ma jikkwalifikax bħala OTC abbażi tad-definizzjoni tal-Artikolu 2(7) tal-EMIR kif emendat mill-Artikolu 32 tal-SFTR, il-kontroparti tibqa' responsabbli u legalment responsabbli li tirrapporta d-dettalji lil TR u d-dispożizzjonijiet relatati mat-trasferiment tar-responsabbiltà u tar-responsabbiltà legali ma japplikawx. Il-kontropartijiet ma jistgħux jassumu li l-opzjonijiet u l-kuntratti tal-futuri nnegożjati kollha fiċ-ċentru tan-negożjar huma ETDs.

### 3.5 Id-delega tar-rapportar

91. Minbarra l-allokazzjoni tar-responsabbiltà li tirriżulta mill-Artikoli 9(1a)-(1d) tal-EMIR u koperta mit-taqsima 3.4, l-EMIR jistipula fl-Artikolu 9(1f) li l-kontropartijiet u s-CCPs li huma soġġetti għall-obbligu ta' rapportar jistgħu jiddelegaw dak l-obbligu ta' rapportar, dan jinkludi kwalunkwe komputu (indivdwalment u separatament) relatat mar-rapportar tad-*data*. Fil-każ tad-delega tar-rapportar, il-kontroparti li tiddelega għandha tipprovdi lill-entità li tippreżenta rapport id-dettalji kollha tal-kuntratti tad-derivattivi u hija responsabbli li tiżgura li dawk id-dettalji jkunu korretti. Fil-każ ta' delega, il-proċessi u l-iskedi ta' żmien għandhom ikunu l-istess bħal fil-każ ta' allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar deskritt fit-taqsima 3.4. Minkejja li fuq il-livell tekniku, hemm ħafna similaritajiet u aspetti ta' proċessar komuni bejn l-allokazzjoni tar-responsabbiltà u d-delega tar-rapportar, legalment huma xenarji ta' rapportar differenti u indipendenti. Għandu jissemma wkoll li l-kontropartijiet tal-UE għandhom jivvalutaw bir-reqqa kwalunkwe riskju li jista' jkun hemm fuq il-konformità tagħhom mal-obbligi ta' rapportar fil-każ tad-delega tar-rapportar għal entità li tippreżenta rapport mhux tal-UE.
92. L-RTS dwar ir-rapportar jipprovdi element tad-*data* speċifiku, il-kamp 1.2 "ID tal-entità li tippreżenta rapport", li għandu bilfors jimtela u fil-każ fejn il-kontroparti li tirrapporta jew l-entità responsabbli mir-rapportar ma ddelegatx is-sottomissjoni tar-rapport lil parti terzi jew lill-kontroparti l-oħra, il-kontroparti li tirrapporta jew l-entità responsabbli mir-rapportar se timla l-LEI tagħha stess. Fil-każ fejn fir-rapportar ta' derivattiv ikunu involuti diversi entitajiet, jiġifieri r-rapportar jitwettaq minn katina ta' entitajiet, il-kamp 1.2 għandu jimtela bl-LEI tal-entità li fl-aħħar tippreżenta r-rapport lit-TR. L-FR dwar l-RTS/ITS (fit-taqsima 4.1.3) jiċċara wkoll li l-RSEs għandhom jinformat lill-kontropartijiet li jirrapportaw u lill-ERRs dwar il-kwistjonijiet ta' rapportar u ta' kwalità tad-*data* rilevanti (inkluż *data* ppreżentata f'isimha, ir-rifjuti kollha, il-waqfiet fir-rikonċiljazzjoni kif ukoll kwistjonijiet oħra tal-kwalità tad-*data* relatati mad-*data* rilevanti) li għalihom l-informazzjoni mhux se tiġi pprovduta mit-TRs, speċjalment jekk dawn il-kontropartijiet li jirrapportaw u l-ERRs mhumienx parteċipanti jew utenti tat-TR. Fl-FR dwar l-RTS/ITS, l-ESMA ċċarat ukoll li r-responsabbiltajiet dwar id-derivattivi pendenti għandhom jiġu maqbula mill-partijiet u koperti mill-ftehim ta' delega. Naturalment il-ftehim ta' delega jeħtieġ li jipprovdi għall-punt ta' żmien meta jidhol fis-seħh u anki għall-punt ta' żmien meta jieqaf ikun effettiv. Ir-responsabbiltajiet tal-kontropartijiet u tal-RSEs fir-rigward tal-kompletezza u tal-preċiżjoni tad-*data*, eż. l-aġġornament tal-LEI, u ġeneralment ir-

responsabbiltà mill-kontenut tar-rapporti tibqa', fil-każ tad-delega, dejjem tal-entità responsabbli mir-rapportar. Il-kontroparti li tiddelega (soġġetta għall-obbligu ta' rapportar) għandha ttiprovdi lill-RSE d-dettalji kollha tad-derivattiv b'mod puntwali, u hija responsabbli li tiżgura li daww id-dettalji jkunu korretti.

93. Id-delega tar-rapportar tinkludi x-xenarji li ġejjin:
  - a. kontroparti waħda tiddelega lill-kontroparti l-oħra;
  - b. kontroparti waħda tiddelega lil parti terza;
  - c. iż-żewġ kontropartijiet jiddelegaw lil parti terza waħda;
  - d. iż-żewġ kontropartijiet jiddelegaw lil żewġ partijiet terzi.
94. F'kwalunkwe mix-xenarji ta' hawn fuq, il-prinċipju li tiġi evitata d-duplikazzjoni u li tiġi żgurata l-kontinwità tar-rapportar għandu jiġi segwit.
95. L-ESMA tneġġegħ ir-rapportar ċentralizzat (jiġifieri permezz taċ-ċentru li fih derivattiv mhux OTC ġie konkluż jew permezz tas-CCP li fiha qed jiġi kklerjat); madankollu, din għandha tkun dejjem kwistjoni ta' ftehim mill-kontropartijiet, abbażi ta' ftehim ta' delega. Kull meta parti terza tkun qed twettaq dik il-funzjoni abbażi ta' ftehim ta' delega (f'isem il-kontroparti jew it-tnejn li huma), għandha tiżgura li d-*data* kollha rilevanti tkun ipprovduta kif xieraq u f'waqtha mill-kontropartijiet sabiex jinthalaq l-obbligu ta' rapportar.
96. Aktar kjarifiki għandhom jiġu nnotati fir-rigward tad-delega tal-kompiti fil-każ li parti terza tintuża għar-rapportar u ta' kwalunkwe differenzi possibbli fil-kriterji għad-delega skont l-Istat Membru domiciljari tal-entità li tiddelega. L-ewwel nett, il-kontroparti li tirrapporta, ERR jew RSE, tista' tiddeċiedi li tiddelega kwalunkwe komputu relatat mar-rapportar tad-*data*, inkluż il-ġenerazzjoni tal-UTI. It-tieni nett, attwalment mhuma stabbiliti l-ebda regoli speċifiċi dwar kif id-delega għandha titwettaq, iżda d-dispożizzjonijiet kollha tal-EMIR għandhom jiġu rrispettati (rapportar puntwali u preċiż, eċċ.) u l-kontropartijiet għandhom jibqgħu responsabbli mill-kontenut tar-rapporti u għal kwalunkwe rapportar hażin mill-entitajiet terzi li jistrieħu fuqhom. Id-dokumentazzjoni legali li tkopri l-arrangament ta' delega hija rakkomandata (eż. ftehim bil-miktub bejn l-entità responsabbli mir-rapportar u l-entità li tippreżenta rapport, anki jekk soġġetta wkoll għar-rekwiżit tar-rapportar, bħall-kontroparti l-oħra jew is-CCP).
97. Pereżempju d-ditti tal-investment li jipprovdu biss servizzi ta' investment (bħall-eżekuzzjoni tal-ordnijiet jew ir-riċevuta u t-trażmissjoni tal-ordnijiet) m'għandhom l-ebda obbligu li jirrapportaw skont l-EMIR sakemm ma jsirux kontroparti għal derivattiv billi jaġixxu bħala prinċipal. Madankollu, xejn ma jwaqqaf lill-kontropartijiet għal derivattiv milli jużaw ditta ta' investment (li taġixxi bħala sensar) bħala parti terza għar-rapportar lit-TR.
98. Fil-każ fejn maniġer tal-portafoll ikun involut, jiġifieri entità li lilha jiġi ddelegat it-twetliq (jew ta' parti) tal-istrategija ta' investment ta' kontroparti, dan il-maniġer tal-portafoll għandu jiġi identifikat (fil-kamp rilevanti) biss meta dik l-entità taqdi, de jure jew de facto, wieħed mir-rwoli identifikati fid-*data* tal-kontroparti ta' rapport derivattiv, eż. sensar. Inkella dik l-entità m'għandhiex tiġi identifikata.

## 3.6 Ir-rapportar tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja

### 3.6.1 Tipi ta' azzjoni

99. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-konklużjoni, il-modifika u t-terminazzjoni ta' derivattiv.
100. F'każ li l-ebda dettall tad-derivattiv, kif espress fil-kampijiet tad-*data*, ma jkun inbidel, il-kontropartijiet m'għandhomx jirrapportaw mill-ġdid id-dettalji tad-derivattiv. L-unika eċċezzjoni hija l-aġġornament tad-derivattivi pendenti fil-perjodu ta' tranżizzjoni kif deskritt fit-taqsim 3.1.
101. Barra minn hekk, il-kontropartijiet li huma meħtieġa jirrapportaw il-valwazzjoni u l-kollateral, jiġifieri l-FCs, l-NFC+ u s-CCPs, għandhom jirrapportaw kuljum id-dettalji tal-valwazzjoni u tal-kollateral kif ikunu fl-aħħar tal-ġurnata, għad-derivattivi pendenti kollha tagħhom.
102. Il-kontropartijiet għandhom jużaw tip ta' azzjoni "Modifika" biex jirrapportaw il-modifiki tad-dettalji ta' derivattiv, "Valwazzjoni" biex jirrapportaw it-tibdil fil-valur ta' derivattiv u "Aġġornament tal-marġni" biex jirrapportaw il-modifiki tal-kollateral korrispondenti.
103. Il-kontropartijiet għandhom jiżguraw li t-tipi ta' azzjoni "Modifika" u "Korrezzjoni" jintużaw sew. B'mod partikolari, "Modifika" għandu jintuża biex jiġu rrapportati l-modifiki fit-termini jew fid-dettalji ta' derivattiv irrapportat qabel, inkluż meta kontroparti tipprovdi informazzjoni addizzjonali li qabel ma kinitx disponibbli fil-mument tar-rapportar. "Modifika" m'għandux jintuża biex jiġu rrapportati l-korrezzjonijiet tad-dettalji tad-derivattivi – "Korrezzjoni" biss għandu jintuża għal dak l-iskop.
104. B'mod simili, fil-każ tad-*data* dwar il-kollateral, it-tip ta' azzjoni "Aġġornament tal-marġni" għandu jintuża biex jiġi rrapportat il-kollateral għall-ewwel darba kif ukoll biex jiġu rrapportati l-modifiki tad-*data* dwar il-kollateral, iżda mhux il-korrezzjonijiet tad-dettalji dwar il-kollateral irrapportati qabel li għandhom isiru bit-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni". Bidla fil-kodiċi tal-portafoll tal-kollateral għandha tiġi rrapportata b'"Modifika" (biex jiġi aġġornat il-kodiċi għal derivattiv speċifiku fil-portafoll) u b'"Aġġornament tal-marġni" (meta jiġu ppreżentati d-dettalji tal-kollateral fil-livell tal-portafoll). Madankollu, jekk il-bidla fl-informazzjoni tal-kodiċi tal-portafoll issir minħabba żball inizjali fir-rapportar, tali bidla għandha tiġi rrapportata bit-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni".
105. Fil-prinċipju, rapport wieħed biss fil-ġurnata, bit-tip ta' azzjoni "Aġġornament tal-marġni", huwa mistenni. Madankollu, jekk kontroparti tidentifika li kienet ippreżentat *data* dwar il-kollateral żbaljata għal ġurnata speċifika, għandha tippreżenta rapport tal-kollateral bit-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni" għal dik il-ġurnata (billi tiġi speċifikata fil-kamp "Data tal-event" u fil-"Kronogramma tal-kollateral" il-ġurnata li għaliha d-*data* hija korretta).
106. Il-kollateral f'livell ta' derivattiv wieħed jista' jiġi rrapportat għall-ewwel darba bħala parti mir-rapport tad-derivattiv bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" jew separatament bit-

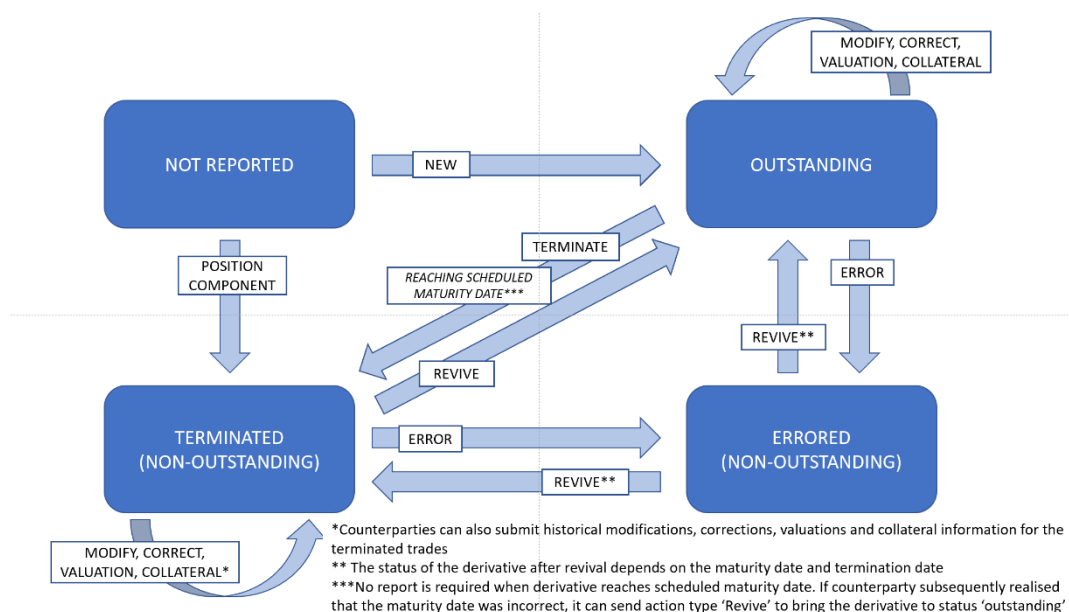
tip ta' azzjoni "Aġġornament tal-marġni". Il-kollateral fil-livell tal-portafoll għandu jiġi rrapportat għall-ewwel darba bit-tip ta' azzjoni "Aġġornament tal-marġni". Il-kollateral il-ġdid huwa mistenni li jiġi rrapportat biss meta mill-inqas derivattiv wieħed kopert b'dak il-kollateral kien irrapporjat u mhux żbaljat. Il-verifika li l-kollateral ma ġiex irrapporjat meta l-ebda derivattiv korrispondenti ma ġie rrapportat għandha titwettaq bħala parti mill-validazzjonijiet tat-TR. Jekk kontroparti tippreżenta b'mod żbaljat iż-żewġ derivattivi u l-kollateral korrispondenti, l-iżball fid-derivattivi jirriżulta awtomatikament fl-iżball fil-kollateral peress li ma jkunx għad hemm xi derivattivi korrispondenti.

107. Fil-każ li rapport dwar l-aġġornament tal-marġni jiġi ppreżentat lit-TR minn kontroparti mingħajr l-obbligu li tirrapporta l-kollateral kuljum (iżda d-derivattivi korrispondenti jkunu validi u m'għandhomx ikollhom żbalji), dik il-kontroparti m'għandha tippreżental-ebda aġġornament tal-marġni ulterjuri.

### Is-sekwenzi tat-tipi ta' azzjoni

108. Sabiex tiġi żgurata koerenza loġika bejn ir-rapporti differenti dwar l-istess derivattivi, ir-regoli ta' validazzjoni tat-TRs ikopru, fost oħrajn, is-sekwenzi korretti tat-tipi ta' azzjoni.

### ILLUSTRAZZJONI 6: IS-SEKVENZI PERMESSI TAT-TIPI TA' AZZJONI



109. Il-kaxxi l-blu fiċ-ċart tal-Illustrazzjoni 6 jispeċifikaw l-istatus ta' derivattiv, filwaqt li t-tipi ta' azzjoni permessi huma indikati fuq il-vleġeġ. Pereżempju, meta derivattiv jiġi rrapportat għall-ewwel darba bit-tip ta' azzjoni "Ġdid", l-istatus jinbidel minn "Mhux irrapporjat" għal "Pendenti". Jekk kontroparti tirrapporta sussegwentement "Żball" għal dak id-derivattiv, l-istatus jinbidel minn "Pendenti" għal "Żbaljat (mhux pendenti)". Għal derivattiv li għandu tali status, l-uniku tip ta' azzjoni permess huwa

“Ftuħ mill-ġdid” (l-uniku tip ta’ azzjoni fuq il-vleġeġ li jibdew fil-kaxxa l-blu bl-istatus “Żbaljat (mhux pendenti)”. Jekk ippreżentat - dan jibdel l-istatus tad-derivattiv lura għal “Pendenti” jew għal “Terminat (mhux pendenti)”, skont id-data tal-maturità/tat-terminazzjoni ta’ dak id-derivattiv. Id-dipendenzi kollha bejn it-tipi ta’ azzjoni u l-istatuses tad-derivattivi indikati fiċ-ċart għandhom jinqraw b’dan il-mod.

110. Id-dipendenzi kollha deskritti fiċ-ċart japplikaw għar-rapporti ta’ kontroparti partikolari. Jiġifieri r-rapporti mibgħuta mill-parti l-oħra għan-negozju ma jaffettwawx it-tipi ta’ azzjoni permessi rrapportati mill-ewwel kontroparti. Japplika b’mod partikolari għat-tip ta’ azzjoni “Żball”, li jfisser li jekk kontroparti waħda ppreżentat “Żball” għal UTI partikolari (u ma rrapportatx “Ftuħ mill-ġdid” wara), dik il-kontroparti biss mhux se tkun tista’ tibgħat aktar rapporti (minbarra “Ftuħ mill-ġdid”) għal dan l-UTI. B’dan il-mod, jekk kontroparti waħda tirrapporta “Żball” bi żball, dan mhux se jwaqqaf lill-kontroparti l-oħra milli tirrapporta puntwalment l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja rilevanti.
111. It-tipi ta’ azzjoni “Modifika”, “Korrezzjoni”, “Aġġornament tal-marġni” u “Valwazzjoni” ma jaffettwawx l-istatus tad-derivattiv. Huma permessi li jiġu rrapportati għal tranżazzjonijiet terminati biss fil-każ ta’ rapportar tard iżda ma jistgħux jintużaw biex jibdlu l-istatus tad-derivattiv għal pendenti (eż. billi jimmodifikaw id-data ta’ maturità). It-tip ta’ azzjoni “Ftuħ mill-ġdid” biss jista’ jintuża biex jinbidel l-istatus tad-derivattiv għal pendenti.
112. It-tip ta’ azzjoni “Ftuħ mill-ġdid” jista’ jintuża biex jerġa’ jiftaħ id-derivattivi kkanċellati (bit-tip ta’ azzjoni “Żball”), terminati bi żball (bit-tip ta’ azzjoni “Terminazzjoni”) u biex jerġa’ jiftaħ id-derivattivi li laħqu d-data ta’ maturità (irrapportata ħażin). Barra minn hekk, “Ftuħ mill-ġdid” jista’ jintuża wara t-tip ta’ azzjoni “Komponent ta’ pożizzjoni”, jekk dan tal-aħħar kien irrapportat bi żball. F’tali każ, id-derivattiv li nfetaħ mill-ġdid fil-livell tan-negozju se jitqies bħala pendenti, soġġett għad-data ta’ skadenza. Jekk il-kontroparti rrapportat pożizzjoni ġdida jew modifika ta’ pożizzjoni, teħtieġ li titreġġa’ lura separatament (billi jsir żball jew modifika fuq tali pożizzjoni, rispettivament).
113. Meta jirrapportaw “Ftuħ mill-ġdid”, il-kontropartijiet għandhom jipprovdu d-dettalji kollha applikabbli tal-kuntratt mill-ħin tal-ftuħ mill-ġdid. Madankollu, il-kontropartijiet għandhom ukoll jippreżentaw kwalunkwe rapporti neqsin li kellhom isiru waqt li d-derivattiv kien temporanjament mhux pendenti. Dan jinkludi r-rapporti bit-tip ta’ azzjoni “Korrezzjoni” biex jiġi korrett kwalunkwe valur speċifiku fir-rapport, minbarra għal meta l-unika korrezzjoni saret biex taġġorna d-derivattiv għal status ta’ pendenti (fejn tali status jista’ jinftiehem mir-rapport “Ftuħ mill-ġdid” innifsu).
114. L-ilħuq tad-data ta’ maturità skedata mhuwiex avveniment li jista’ jiġi rrapportat ta’ EMIR mill-kontropartijiet. L-ebda tip ta’ azzjoni ma japplika f’dan il-każ, inkluż iżda mhux limitat għal “Żball” u “Terminazzjoni”. Malli derivattiv jilħaq id-data ta’ maturità tiegħu, ma jibqax jitqies bħala pendenti. Derivattiv li ma jibqax pendenti u jiġi rrapportat tard bit-tip ta’ azzjoni “Ġdid” wara li jilħaq id-data ta’ maturità tiegħu, se jitqies bħala mhux pendenti.

115. Meta derivattiv jiġi inkluż f'din il-pożizzjoni, l-istatus ta' dak id-derivattiv jinbidel għal "Terminat (mhux pendent)". Kwalunkwe avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja sussegwenti għandhom jiġu rrapportati fil-livell tal-pożizzjoni b'UTI differenti (dak tal-pożizzjoni), u s-sekwenza korretta ta' dawn ir-rapporti għal dik il-pożizzjoni jeħtieġ li tiġi vvalidata wkoll. Madankollu, huwa possibbli li tintbagħat korrezzjoni fil-livell tan-negozju għal derivattiv li kien irrapportat bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", jekk xi dettalji ta' dak id-derivattiv kienu żbaljati.
116. Ir-rapporti għandhom jintbagħtu f'sekwenza kronoloġika li fiha seħħew l-avvenimenti, f'konformità mar-rekwiżiti stabbiliti fl-ITS dwar ir-rapportar. Madankollu, huwa rikonoxxut li fil-każijiet li fihom entità tonqos milli tirrapporta fil-ħin jew issir konxja tas-sottomissjoni tal-passat ta' informazzjoni mhux korretta, l-entità għandha tibgħat ir-rapporti b'dati tal-avvenimenti passati biex b'hekk tkisser l-ordni kronoloġiku.
117. Jekk ikun hemm żball f'sottomissjoni tal-valwazzjoni storika, il-valwazzjoni għal dik id-data li għaddiet biss trid tiġi korretta u l-valwazzjonijiet korretti ppreżentati wara l-messaġġ tal-valwazzjoni żbaljata m'għandhomx għalfejn jiġu rrapportati mill-ġdid. Madankollu, fil-każ fejn diversi messaġġi ta' "Valwazzjoni" ġew irrapportati b'mod żbaljat u kienu meħtieġa l-korrezzjonijiet - il-kontroparti għandha tippreżenta rapport ta' korrezzjoni għal kull ġurnata meta l-valwazzjoni żbaljata ġiet ippreżentata.
118. It-TRs għandhom jivvalidaw is-sekwenzi korretti tat-tipi ta' azzjoni billi jqisu l-kontenut tal-kamp "Data tal-event". Fir-rigward ta' kif it-TRs għandhom jittrattaw ir-rapporti b'dati ta' event passati bl-iskop li jinbena r-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju, aktar dettalji huma inklużi fit-taqsima 6.1.

### 3.6.2 Kombinamenti tat-tipi ta' azzjoni u tat-tipi ta' event

119. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw, fejn applikabbli, it-tip ta' event rilevanti, kif speċifikat fil-kamp 2.152 fl-RTS dwar ir-rapportar.
120. It-tabella t'hawn taħt turi l-kombinamenti permissibbli tat-tipi ta' azzjoni u tat-tipi ta' event, kif ukoll tistabbilixxi jekk japplikawx fil-livell tan-negozju, fil-livell tal-pożizzjoni jew fit-tnejn. L-aħħar kolonna tat-tabella tindika meta tip ta' azzjoni partikolari tista' tiġi rrapportata mingħajr tip ta' event.

**TABELLA 5 - Kombinamenti permissibbli tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event**

|                 |                          | Tip ta' event |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             |                                  |
|-----------------|--------------------------|---------------|-----------|------|-----------------------|-----------|------------|--------------|-------------------|--------------------------|-------------------|-------------|----------------------------------|
|                 |                          | KUMMERĊ       | INTERVENT | PTRR | TERMINAZZJONI BIKRIJA | IKKLERJAR | EŻERĊIZZJU | ALLOKAZZJONI | EVENT TA' KREDITU | INKLUŻJONI F' POŻIZZJONI | EVENT KORPORATTIV | AĠĠORNAMENT | L-ebda Tip ta' Event mhu meħtieġ |
| Tip ta' azzjoni | ĠDID                     | N             | N,P       | N    |                       | N         | N          | N            |                   | P                        | N,P               |             |                                  |
|                 | MODIFIKA                 | N,P           | N,P       | N,P  | N,P                   |           | N,P        | N            | N,P               | P                        | N,P               | N,P         | P                                |
|                 | KORREZZJONI              |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N,P                              |
|                 | TERMINAZZJONI            |               | N,P       | N,P  | N,P                   | N         | N,P        | N            | N,P               | N,P                      | N,P               |             |                                  |
|                 | ŻBALL                    |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N,P                              |
|                 | FTUH MILL-ĠDID           |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N,P                              |
|                 | VALWAZZJONI              |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N,P                              |
|                 | AĠĠORNAMENT TAL-MARĠNI   |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N,P                              |
|                 | KOMPONENT TA' POŻIZZJONI |               |           |      |                       |           |            |              |                   |                          |                   |             | N                                |

121. It-Tabella 6 tiċċara l-applikabbiltà tal-kombinamenti permissibbli kollha ta' tip ta' azzjoni-tip ta' event kif ukoll tipprovdi kummenti addizzjonali dwar l-użu attwali fejn tali taħlitiet jiġu rrapportati jew, għall-kuntrarju, fejn m'għandhomx jintużaw.
122. L-immappjar komprensiv bejn l-avvenimenti tan-negozju u l-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event huwa pprovdut fit-taqsima 3.10.
123. Għandu jiġi nnotat li l-ebda tip ta' event mhuwa maħsub għat-trasferiment. L-ESMA ttenni li t-trasferiment għandu jitwettaq f'konformità mal-Linji Gwida dwar it-trasferiment tad-data bejn it-TRS<sup>21</sup>. It-tipi ta' azzjoni "Ġdid" u "Terminazzjoni" m'għandhomx jintużaw għal dak l-iskop.

**Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event**

| Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Applikabbiltà                                                                                                          | Kummenti                                                                                                                                                      |
|-----------------|---------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Ġdid            | Negozju       | Meta derivattiv b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba permezz tan-negozju u mhux minħabba avveniment preċedenti ieħor. | Il-kombinament "Ġdid"- "Ikklerjar" għandu jintuża għad-derivattivi l-ġodda li jirriżultaw mill-ikklerjar, b'mod partikolari għad-derivattivi n-negozjati fiċ- |

<sup>21</sup>
[https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-2351\\_final\\_report\\_-\\_guidelines\\_on\\_data\\_transfer\\_between\\_trade\\_repositories\\_emir\\_sfr.pdf](https://www.esma.europa.eu/sites/default/files/library/esma74-362-2351_final_report_-_guidelines_on_data_transfer_between_trade_repositories_emir_sfr.pdf)

| Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event |                         |                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni                                                              | Tip ta' event           | Applikabbiltà                                                                                                                | Kummenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|                                                                              |                         |                                                                                                                              | ċentri tan-negozjar u kklerjati fil-istess ġurnata minn CCP.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| Ġdid                                                                         | Intervent               | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba minħabba event ta' intervent.                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Ġdid                                                                         | PTRR                    | Meta derivattiv b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba minħabba event PTRR.                                                   | Il-kombinament "Ġdid"- "PTRR" fil-livell tal-pożizzjonijiet mhix applikabbli, peress li kwalunkwe derivattiv maħluq reċentement minħabba event PTRR huwa mistenni li jiġi rrapportat fil-livell tan-negozju (mingħajr preġudizzju għall-possibbiltà li tali derivattiv jiġi inkluż sussegwentement f'pożizzjoni). Il-kombinament "Ġdid"- "PTRR" jista' jintuża fil-każ ta' riekwilibriju. |
| Ġdid                                                                         | Ikklerjar               | Meta derivattiv b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba minħabba event ta' kklerjar.                                           | Dan il-kombinament jinkludi wkoll ikklerjar ta' derivattivi OTC li ġew preċedentement miftiehma b'mod bilaterali fost il-kontropartijiet u sussegwentement ikklerjati.                                                                                                                                                                                                                    |
| Ġdid                                                                         | Eżerċizzju              | Meta derivattiv b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba minħabba event ta' eżerċizzju.                                         | Dan il-kombinament għandu jintuża meta s-swap sottostanti jiġi rrapportat wara t-twettiq ta' swapzjoni                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| Ġdid                                                                         | Allokazzjoni            | Meta derivattiv b'UTI ġdid jinħoloq għall-ewwel darba minħabba event ta' allokkazzjoni.                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Ġdid                                                                         | Inklużjoni f'pożizzjoni | Meta tinħoloq pożizzjoni ġdida permezz tal-inklużjoni tan-negozji f'dik il-pożizzjoni għall-ewwel darba.                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Ġdid                                                                         | Event Korporattiv       | Meta jinħoloq derivattiv jew pożizzjoni b'UTI ġdid għall-ewwel darba minħabba azzjoni korporattiva fuq l-ekwità sottostanti. |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| Modifika                                                                     | Negozju                 | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi mmodifikat minħabba n-                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

| Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event |                         |                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni                                                              | Tip ta' event           | Applikabbiltà                                                                                                                                                                                                                                                                 | Kummenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|                                                                              |                         | negozjar mill-ġdid tat-termini tan-negozju, minhabba t-tibdil fit-termini tan-negozju miftiehma minn qabel fil-kuntratt (ħlief meta tali tibdil ikun diġà ġie rrapportat eż. l-iskeda nozzjonali) jew għax elementi tad-data li qabel ma kinux disponibbli jsiru disponibbli. |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Intervent               | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi modifikat minhabba event ta' intervent.                                                                                                                                                                                   | Dan il-kombinament jinkludi wkoll trasferiment ta' derivattiv fil-livell tan-negozju jew tal-pożizzjoni minn CCP għal oħra.                                                                                                                                                                                     |
| Modifika                                                                     | PTRR                    | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi modifikat minhabba event PTRR.                                                                                                                                                                                            | Il-kombinament "Modifika"- "PTRR" fil-livell tal-pożizzjoni għandu jintuża biss fil-każ fejn il-pożizzjonijiet tas-CCP ikunu soġġetti għal PTRR (iktar milli nnettjar bilaterali u rapportar sussegwenti fil-livell tal-pożizzjoni). Il-kombinament "Modifika"- "PTRR" jista' jintuża fil-każ ta' kompressjoni. |
| Modifika                                                                     | Terminazzjoni bikrija   | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi mmodifikat minhabba terminazzjoni bikrija miftiehma minn qabel jew minhabba terminazzjoni parzjali.                                                                                                                       | Fil-każ ta' terminazzjoni bikrija miftiehma minn qabel, il-kontropartijiet għandhom jaġġornaw id-data ta' maturità. Fil-każ ta' terminazzjoni bikrija parzjali, il-kontropartijiet għandhom jaġġornaw in-nozzjonali.                                                                                            |
| Modifika                                                                     | Eżerċizzju              | Meta derivattiv jew pożizzjoni jiġu mmodifikati minhabba l-eżerċizzju ta' opzjoni jew swapzjoni.                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Allokazzjoni            | Meta derivattiv b'UTI eżistenti jiġi allokat parzjalment. Dan jintuża biex jirrapporta n-nozzjonal emendat tad-derivattiv eżistenti.                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Event ta' kreditu       | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi modifikat minhabba event ta' kreditu.                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Inklużjoni f'pożizzjoni | Meta pożizzjoni b'UTI eżistenti tiġi modifikata minhabba l-inklużjoni ta' negozju ġdid.                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Event Korporattiv       | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi modifikat minhabba                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

| Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event |                                  |                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni                                                              | Tip ta' event                    | Applikabbiltà                                                                                                                                                                         | Kummenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|                                                                              |                                  | azzjoni korporattiva fuq l-ekwità sottostanti.                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | Aġġornament                      | Meta derivattiv jew pożizzjoni li huwa pendenti fuq id-data tal-bidu tar-rapportar jiġi aġġornat sabiex jikkonforma mar-rekwiżiti tar-rapportar emendati.                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Modifika                                                                     | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta pożizzjoni b'UTI eżistenti tiġi modifikata minħabba iktar minn tip wieħed ta' avvenimenti tan-negozju li seħħew fl-istess ġurnata.                                               | Ir-rapportar fl-istess ġurnata mhuwiex obligatorju għall-ETDs, konsegwentement il-kontropartijiet jingħataw il-permess li jirrapportaw "Modifika" fil-livell tal-pożizzjoni mingħajr ma jindikaw it-tip ta' event, fejn tali modifikazzjoni tkun ir-riżultat ta' iktar minn tip wieħed ta' avvenimenti tan-negozju li seħħew fl-istess ġurnata. |
| Korrezzjoni                                                                  | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jew id-data relatata mal-kollateral tiġi korretta minħabba sottomissjoni preċedenti ta' informazzjoni żbaljata.                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Terminazzjoni                                                                | Intervent                        | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minħabba event ta' intervent. Dan jintuża għat-terminazzjoni tal-UTI antik wara l-intervent.                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Terminazzjoni                                                                | PTRR                             | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minħabba event PTRR. Dan jintuża biex il-UTI(s) antik(i) jiġi/u terminati wara l-operazzjoni PTRR.                       | Il-kombinament "Modifika"- "PTRR" jista' jintuża fil-każ ta' kompressjoni.                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| Terminazzjoni                                                                | Terminazzjoni bikrija            | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minħabba terminazzjoni bikrija (u meta l-ebda kawża/event ieħor mhuwa magħruf bħala r-raġuni għal dik it-terminazzjoni). |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Terminazzjoni                                                                | Ikklerjar                        | Meta derivattiv b'UTI eżistenti jiġi terminat minħabba event ta' kklerjar. Dan jintuża għat-terminazzjoni tan-negozji alfa.                                                           | Fil-każ tad-derivattivi OTC konkluzi b'mod bilaterali, il-kontropartijiet jeħtieġu jittterminaw in-negozji bilaterali rapportati qabel (bil-kombinament "Terminazzjoni"- "Ikklerjar")                                                                                                                                                           |

| Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event |                                  |                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni                                                              | Tip ta' event                    | Applikabbiltà                                                                                                                                                                        | Kummenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|                                                                              |                                  |                                                                                                                                                                                      | u jirrapportaw in-negozji ġodda kklerjati (bil-kombinament "Ġdida"- "Ikklerjar"). Dan jinkludi wkoll xenarju fejn derivattivi eżistenti jsiru eliġibbli għall-ikklerjar fi stadju iktar tard.                                                                                                                                                                            |
| Terminazzjoni                                                                | Eżerċizzju                       | Meta derivattiv b'UTI eżistenti jiġi terminat minhabba event ta' eżerċizzju. Eż. dan jintuża biex jiġu terminati l-opzjonijiet/is-swapzjonijiet meta dawn ikunu qed jiġu eżerċitati. | "Terminazzjoni"- "Eżerċizzju" m'għandhomx jiġu rrapportati meta l-opzjoni tiġi eżerċitata fid-data tal-maturità. B'mod iktar ġenerali, it-terminazzjonijiet li jseħħu f'data qabel id-data ta' maturità biss għandhom jiġu rrapportati.                                                                                                                                  |
| Terminazzjoni                                                                | Allokazzjoni                     | Meta derivattiv b'UTI eżistenti jiġi terminat minhabba event ta' allokkazzjoni. Dan jintuża għat-terminazzjoni tal-UTI antik wara l-allokkazzjoni.                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| Terminazzjoni                                                                | Event ta' kreditu                | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minhabba event ta' kreditu.                                                                                             | Dan il-kombinament għandu jiġi rrapportat meta event ta' kreditu jwassal għat-terminazzjoni u għas-saldu tad-derivattivi, eż. CDS taħt isem wieħed.                                                                                                                                                                                                                      |
| Terminazzjoni                                                                | Inklużjoni f'pożizzjoni          | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minhabba inklużjoni f'pożizzjoni.                                                                                       | Derivattiv fil-livell tan-negozju li huwa immedjatament inkluż f'pożizzjoni, għandu jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni". Huwa biss meta derivattiv jiġi inkluż fil-pożizzjoni wara li jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" li għandu jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Inklużjoni f'pożizzjoni". |
| Terminazzjoni                                                                | Event Korporattiv                | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jiġi terminat minhabba azzjoni korporattiva fuq l-ekwità sottostanti.                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| Żball                                                                        | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti jithassar minhabba sottomissjoni bikrija jew                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

| Tabella 6 - Applikabbiltà tal-kombinamenti tat-tip ta' azzjoni-tip ta' event |                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni                                                              | Tip ta' event                    | Applikabbiltà                                                                                                                                                                                                                                                              | Kummenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|                                                                              |                                  | informazzjoni żbaljata. Eż. dan jintuża biex jithassar il-UTI ta' derivattiv jew pożizzjoni li ma kellux jiġi rrapportat (eż. mhuwiex tranżazzjoni ta' derivattiv) jew biex jithassru derivattivi pendenti meta l-kontroparti tibda tibbenefika minn eżenzjoni intragrupp. |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Ftuħ mill-ġdid                                                               | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta derivattiv jew pożizzjoni li tħassret jerga'/terġa' jiddaħħal/tiddaħħal minhabba sottomissjoni preċedenti ta' informazzjoni żbaljata. Eż. dan jintuża biex jerga' jiddaħħal il-UTI ta' derivattiv jew pożizzjoni li ġie terminat bi żball.                            | Dan it-tip ta' azzjoni m'għandux jintuża biex tinfetaħ mill-ġdid pożizzjoni li preċedement ġiet innettjata u terminata. "Ftuħ mill-ġdid" għandu jintuża biss biex jinfetħu mill-ġdid in-negozji li ġew terminati jew tħassru bi żball jew li tħassru minhabba eżenzjoni IGT, sabiex il-kontropartijiet ma jkollhomx jiġġeneraw mill-ġdid UTI ġdid. M'għandux jintuża għal xenarji ta' rapportar oħra. B'mod partikolari fil-każ ta' pożizzjoni nnettjata, il-kontropartijiet jeħtieġ li jiddeċiedu jekk iżommux il-pożizzjoni miftuħa (u jirrapportaw il-valwazzjoni kif xieraq) jew jagħlquhiex. Jekk il-kontropartijiet jagħlqu l-pożizzjoni u mbagħad jidhlu f'kuntratt tad-derivattiv ieħor tal-istess tip u jridu jirrapportaw fil-livell tal-pożizzjoni, għandhom jirrapportaw pożizzjoni ġdida b'UTI ġdid. |
| Valwazzjoni                                                                  | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta <i>data</i> relatata mal-valwazzjoni tiġi ppreżentata għal derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti.                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Aġġornament tal-marġni                                                       | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta <i>data</i> relatata mal-kollateral tiġi ppreżentata għal derivattiv jew pożizzjoni b'UTI eżistenti.                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Komponent ta' pożizzjoni                                                     | L-ebda tip ta' event mhu meħtieġ | Meta derivattiv ġdid jiġi konkluż u inkluż f'pożizzjoni fl-istess ġurnata.                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

124. Meta kontroparti tippreżenta bi żball tip ta' event żbaljat, m'hemm l-ebda possibbiltà li tali informazzjoni tiġi korretta, għax "Tip ta' event" mhuwiex applikabbli għat-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni". Il-kontroparti għandha tiżgura li tippreżenta "Tip ta' event" xieraq fir-rapport sussegwenti.

### 3.6.3 L-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja u l-użu tal-IDs ta' kollegament (UTI preċedenti, ID PTRR, UTI tal-pożizzjoni sussegwenti)

125. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw, fejn rilevanti, l-IDs ta' kollegament biex jippermettu l-identifikazzjoni tar-rapporti relatati mal-istess avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja. L-IDs ta' kollegament maħsuba għal dak l-iskop huma li ġejjin:
- "UTI preċedenti" (kamp 2.3)
  - "UTI tal-pożizzjoni sussegwenti" (kamp 2.4)
  - "ID PTRR" (kamp 2.5)
126. "UTI preċedenti" għandu jintuża fil-każ ta' dawk l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja fejn derivattiv uniku jiġi terminat u jinħoloq derivattiv wieħed jew iktar. F'tali każijiet, il-UTI preċedenti, jiġifieri l-UTI tad-derivattiv li ġie terminat, għandu jimtela fil-kamp 2.3 fir-rapporti relatati mad-derivattivi kollha maħluqa minħabba l-avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja. B'mod partikolari, l-UTI preċedenti se jkun applikabbli fl-eventi li ġejjin:
- Intervent;
  - Ikklerjar (sakemm id-derivattiv ma ġiex konkluz f'ċentru tan-negozjar jew f'pjattaforma tan-negozjar organizzata minn pajjiż terz u kklerjat minn CCP fl-istess ġurnata);
  - Eżerċizzju (fil-każ ta' swapzjonijiet),
  - Allokazzjoni,
  - Event korporattiv (fil-każ ta' qsim).
127. UTI tal-pożizzjoni sussegwenti għandu jiġi rrapportat meta derivattiv ikun inkluż f'pożizzjoni (u rrapportat bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni" jew bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Inklużjoni f'pożizzjoni"). Għandu jinkludi l-UTI tal-pożizzjoni li fiha huwa inkluż dan id-derivattiv.
128. ID PTRR għandu jiġi rrapportat meta t-tip ta' event huwa "PTRR" u t-tip ta' teknika PTRR hija kompressjoni b'fornitur tas-servizz terz jew riekwilibriju. L-istess ID PTRR, kif ipprovdut mill-fornitur tas-servizz PTRR, għandu jiġi rrapportat f'kull rapport li jinħoloq, jiġi modifikat jew terminat minħabba l-istess event PTRR. Kull event PTRR għandu jiġi assenjat ID PTRR differenti.
129. Huwa possibbli li jiġu rrapportati iktar minn ID ta' kollegament waħda għal derivattiv partikolari (eż. derivattiv jista' jiġi rrapportat l-ewwel b'UTI preċedenti meta jiġi kklerjat, imbagħad jista' jiġi rrapportat b'ID PTRR jekk jiġi modifikat minħabba event PTRR u finalment jista' jiġi rrapportat b'UTI tal-pożizzjoni sussegwenti jekk fl-aħħar jiġi inkluż f'pożizzjoni). Madankollu, l-ID ta' kollegament

rilevanti biss għandha tiġi rrapportat fir-rapport relatat ma' avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja partikolari (fl-eżempju ta' fuq, il-kontroparti li tirrapporta l-inklużjoni fil-pożizzjoni timla f'dak ir-rapport biss il-kamp "UTI tal-pożizzjoni sussegwenti").

### 3.7 Ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni

130. F'termini ġenerali, "pożizzjoni" għandha tinftiehem bħala l-iskopertura bejn par kontropartijiet, li tikkonsisti f'sett ta' derivattivi funġibbli (negozzji) b'relazzjonijiet ekonomiċi u legali fosthom li tippermetti ġestjoni tar-riskju komuni li jirriżulta f'volum nett jew imnaqqas tal-iskopertura konġunt. Negozzju u tranżazzjoni huma użati b'mod interkambjabbli f'din it-taqsim.
131. Skont l-Artikolu 3 tal-RTS dwar ir-rapportar, huwa possibbli li l-avvenimenti ta' wara n-negozzjar jiġu rrapportati fil-livell tal-pożizzjoni wara r-rapportar inizjali tad-dettalji ta' derivattivi konkluż fil-livell tat-tranżazzjoni u t-terminazzjoni ta' dak id-derivattivi minħabba l-inklużjoni tiegħu f'pożizzjoni, sakemm il-kundizzjonijiet li ġejjin jintlaħqu: l-arranġament legali huwa tali li r-riskju huwa fil-livell tal-pożizzjoni, ir-rapporti tan-negozzjar kollha magħmula lit-TR huma relatati mal-prodotti li huma funġibbli ma' xulxin u n-negozzji individwali rrapportati preċedentement lit-TR ġew sussegwentement sostitwiti b'rapport ta' pożizzjoni (eż. b'hal fil-każ ta' negozji bejn membru tal-ikklerjar u CCP).
132. Il-kategoriji tad-derivattivi eliġibbli għar-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni huma: ETDs, derivattivi OTC ikklerjati ċentralment innettjati mis-CCPs u Kuntratti għad-Differenza (CFDs). Għalkemm fil-każ ta' tali derivattivi l-informazzjoni dwar il-pożizzjonijiet hija l-iktar rilevanti għall-valwazzjoni tar-riskju sistemiku, ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni biss mhuwiex konformi mar-rekwiżiti tal-EMIR skont l-Artikolu 9 tal-EMIR, li jeħtieġ li l-kontropartijiet kollha jirrapportaw, eż. il-konklużjoni ta' derivattivi fil-livell tat-tranżazzjoni.
133. Huwa rakkomandat ħafna li l-kuntratti mingħajr data ta' maturità, b'has-CFDs, jiġu rrapportati fil-livell tal-pożizzjoni biex jiġi evitat li kull derivattivi pendenti individwali għal kontroparti finanzjarja jkun jeħtieġ jirċievi aġġornamenti dwar il-valwazzjoni ta' kuljum sakemm 1) id-derivattivi jiġihassar jew 2) għal dejjem, għax dawn id-derivattivi ġeneralment m'għandhomx maturità. Il-valwazzjoni tista' tiġi pprovduta fil-livell tal-pożizzjoni malli t-tranżazzjonijiet ta' derivattivi korrispondenti jiġu inklużi f'pożizzjoni.
134. L-ESMA tirrikonoxxi d-diffikultajiet potenzjali fil-ftehim bilaterali tal-livell tar-rapportar bejn il-kontropartijiet u l-impatt ta' tali problemi fuq ir-rikonċiljazzjoni. Madankollu, l-ESMA ttenni li r-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni għandu jiġi miftiehem bejn iż-żewġ kontropartijiet għax dan l-obbligu jirriżulta mir-rekwiżit tal-Artikolu 9(1e) tal-EMIR sabiex jiġi żgurat li d-dettalji tal-kuntratti tad-derivattivi jiġu rrapportati b'mod korrett u mingħajr duplikazzjoni. Dawn huwa mistqarr ukoll fl-Artikolu 3 tal-RTS dwar ir-rapportar. Iż-żewġ kontropartijiet f'derivattivi għandhom jew it-tnejn jinkludu d-derivattivi f'pożizzjoni jew it-tnejn ikomplu jirrapportaw l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja rilevanti fil-livell tan-negozzju. Ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni huwa ġeneralment opzjoni, iktar milli rekwiżit u huwa fattibbli biss meta

I-kundizzjonijiet rilevanti kollha jintlaħqu, inkluż meta ż-żewġ kontropartijiet jaqblu dwar ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni. Fin-nuqqas ta' qbil bejn il-kontropartijiet, ir-rapportar fil-livell tan-negozju huwa t-triq 'il quddiem awtomatika. Madankollu, f'ċerti ċirkostanzi, l-unika għażla possibbli għall-konformità mal-obbligi ta' rapportar tal-EMIR hija r-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni (eż. meta l-kontropartijiet mhumieks kapaċi jagħtu valur lill-komponenti ta' pożizzjoni individwali). Anki f'dawn iċ-ċirkostanzi, il-qbil bejn il-kontropartijiet involuti huwa kundizzjoni neċessarja.

135. Ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni tal-istess ġurnata mhuwiex meħtieġ għal kwalunkwe tip ta' derivattiv, la għall-ETD u lanqas għall-OTC, jiġifieri m'hemm l-ebda ħtieġa li jiġu rrapportati l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja (eż. modifiki) ta' pożizzjoni fl-istess ġurnata. Iżda, sabiex pożizzjoni tiġi rrapportata tajjeb u biex il-modifiki kollha li jaffettwawha jiġu riflessi (anki meta negozju jkun inkluż fir-rapport tal-livell tal-pożizzjoni fl-istess ġurnata), id-dettalji u l-valwazzjoni aġġornati tal-pożizzjoni għandhom jiġu rrapportati mill-kontropartijiet fil-livell tal-pożizzjoni fl-aħħar tal-ġurnata. Dan huwa konformi mal-kjarifiki żviluppati fit-taqsimiet 3.6 u 3.9, bħal dik dwar il-possibbiltà li t-tip ta' event jiġi rrapportat bħala "vojt" meta jkun hemm diversi avvenimenti li qed jaffettwaw l-istess pożizzjoni f'ġurnata partikolari sabiex jissimplifikaw ir-rapportar. Fil-livell tan-negozju, ir-rapportar fl-istess ġurnata tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja għan-negozji ETD mhuwiex obligatorju. Għan-negozji OTC, ir-rapportar tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja tal-istess ġurnata għandu jkun komprensiv u fattibbli mill-aħħar tal-ġurnata.
136. Meta tinħoloq pożizzjoni, rapport bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u t-tip ta' event xieraq għandhom jiġu rrapportati. Il-modifiki ta' pożizzjoni minħabba l-inklużjoni jew it-terminazzjoni ta' negozju, eċċ. għandhom jiġu rrapportati bit-tip ta' azzjoni "Modifika" u, sakemm ikun fattibbli, bit-tip ta' event xieraq. Pożizzjoni tintemm meta tintlaħaq id-data ta' maturità tagħha. Jekk it-terminazzjoni ta' pożizzjoni hija dovuta għal raġunijiet oħra, tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u t-tip ta' event li jiddeskrivi r-raġuni għal dik it-terminazzjoni għandhom jiġu rrapportati mill-kontropartijiet. Aktar dettalji huma pprovduti fit-taqsimi 3.6.
137. Billi jitqies li mhuwiex permess li jiġu rrapportati biss il-pożizzjonijiet mingħajr ma jiġu rrapportati qabel id-derivattivi oriġinali fil-livell tan-negozju, tali derivattivi fil-livell tan-negozju għandhom jiġu aġġornati biex ikollhom status xieraq sabiex ikun ċar li m'għadhomx miftuħin u biex jiġi evitat għadd doppju tan-negozji li ġew inklużi fil-pożizzjonijiet. Konsegwentement, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw it-terminazzjonijiet tad-derivattivi kollha fil-livell tan-negozju li jidhru fil-pożizzjoni. Għandu jsir billi jintużaw it-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u t-tip ta' event "Inklużjoni f'pożizzjoni" jew it-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni" mingħajr ma jkun meħtieġ tip ta' event, dan tal-aħħar meta jkun qed jiġi rrapportat negozju ġdid li huwa inkluż fil-pożizzjoni fl-istess ġurnata. Barra minn hekk, il-kamp "Livell" għandu jiġi rrapportat bħala "N" (negozju). B'dan il-mod, in-negozji kollha li ġew inklużi f'pożizzjoni ma jibqgħux jitqiesu pendenti. Imbagħad, il-pożizzjoni għandha tiġi rrapportata bl-użu tat-tip ta' azzjoni "Ġdid" jekk il-pożizzjoni tinħoloq għall-ewwel darba jew tat-tip ta' azzjoni "Modifika" fil-każ ta' aġġornament f'pożizzjoni eżistenti. Il-kamp "Livell" għandu jiġi rrapportat bħala "P" (pożizzjoni) għal kwalunkwe rapportar tal-pożizzjoni.

138. Meta kontroparti tirrapporta fil-livell tal-pożizzjoni, kwalunkwe aġġornament, modifika u avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja sussegwenti (inklużi r-rivalwazzjonijiet) għandhom jiġu applikati mit-TRs għar-rapport tal-pożizzjoni tad-derivattiv u mhux għar-rapporti tan-negozji oriġinali.
139. L-elementi tad-*data* kollha li huma meħtieġa fir-rapporti tan-negozju huma obbligatori wkoll fir-rapportar tal-pożizzjoni, bl-eċċezzjoni ta' dawk li huma rilevanti biss fil-livell tan-negozju.
140. Il-kamp "Nozzjonali" għandu dejjem jimtela fir-rapporti magħmula fil-livell tal-pożizzjoni. Barra minn hekk, il-valur tan-Nozzjonali fir-rapporti tal-livell tal-pożizzjoni għandu jiġi kkalkulat kif ġej:
- a. Għall-opzjonijiet: Nozzjonali = Kwantità totali nozzjonali x Prezz tal-eżerċitar;
  - b. Għall-kuntratti tal-futuri: Nozzjonali = Kwantità totali nozzjonali x Prezz tas-saldu<sup>22</sup>.
141. Ir-rapportar tal-modifiki fil-kamp "Nozzjonali" fil-livell tal-pożizzjoni għandu jseħħ biss jekk ikun seħħ avveniment rilevanti għall-pożizzjoni (eż. negozju rilevanti ġdid ġie inkluż fil-pożizzjoni, dan il-valur nozzjonali ġdid għandu jitqies fin-nozzjonali tal-pożizzjoni). Aktar dettalji huma pprovduti fit-taqsim 3.17 ta' dawn il-Linji Gwida.
142. Fil-każ meta valwazzjoni tal-pożizzjoni issir żero, hemm biss żewġ modi possibbli biex tipproċedi:
- a. Il-pożizzjoni tiġi terminata u waħda ġdida tiġi rrapportata permezz tal-użu ta' UTI differenti fi stadju iktar tard. L-ebda valwazzjoni mhija rrapportata bejn it-terminazzjoni tal-ewwel pożizzjoni u l-ħolqien tal-aħħar.
  - a. Il-pożizzjoni tinżamm miftuħa u valur ta' kuntratt żero jiġi rrapportat ta' kuljum.
143. Id-*"data effettiva"* hija d-*data* li minnha jidhlu fis-seħħ l-obbligi skont id-derivattiv, kif inklużi fil-konferma tad-derivattiv jew miftiehma mod ieħor bejn il-kontropartijiet. Jekk il-kontropartijiet ma speċifikawx id-*data* effettiva bħala parti mit-termini tal-kuntratt, il-kamp "Data effettiva" għandu jimtela bid-*data* tal-eżekuzzjoni tad-derivattiv. Fil-livell tal-pożizzjoni, id-*Data* effettiva għandha tiġi rappreżentata bid-*data* effettiva tan-negozju li għandu d-*data* l-iktar effettiva kmieni. Jekk il-kontropartijiet ma speċifikawx id-*data* effettiva tal-pożizzjoni bħala parti mit-termini tal-kuntratt, il-kamp "Data effettiva" fil-livell tal-pożizzjoni għandu jimtela bid-*data* effettiva tan-negozju tad-derivattiv li għandu d-*data* l-iktar effettiva kmieni jew il-parti tad-*data* tal-kronogramma tal-eżekuzzjoni (din id-*data* ta' eżekuzzjoni tkun id-*data* ta' eżekuzzjoni l-iktar kmieni tal-pożizzjoni) fil-każ li l-kontropartijiet ma speċifikawx id-*data* effettiva tal-kuntratt.
144. Id-*"data ta' skadenza"* hija d-*data* li minnha l-obbligi skont id-derivattiv jieqfu jkunu effettivi, kif inklużi fil-konferma tad-derivattiv jew miftiehma mod ieħor bejn il-kontropartijiet. It-terminazzjoni bikrija ma taffettwax dan l-element tad-*data*. Id-*data* ta' skadenza, fil-livell tal-pożizzjoni, għandha tkun id-*data* ta' skadenza l-iktar 'il

---

<sup>22</sup> Il-prezz tas-saldu mhuwiex kamp li jista' jiġi rrapportat

bogħod fil-futur fost in-negozji li huma inklużi fil-pożizzjoni. Jekk ikun hemm modifika sussegwenti ta' din id-data ta' skadenza, għax din il-possibbiltà kienet oriġinarjament fil-kuntratt ta' dan in-negozju, għandu jintbagħat rapport ta' modifika, li jimmodifika il-kamp tad-“Data ta' skadenza” kif xieraq biex jirrifletti d-data ta' skadenza aġġornata fil-livell tal-pożizzjoni.

145. Id-“data tat-terminazzjoni bikrija” hija d-data li fiha jkun hemm terminazzjoni tad-derivattiv li ssejtn qabel il-maturità tiegħu minhabba eż. deċiżjoni ta' kontroparti jew tal-kontropartijiet. Dwar ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni, tip ta' azzjoni “Terminazzjoni” u tip ta' event “Terminazzjoni bikrija” għandhom jimtlew meta l-pożizzjoni sħiħa tiġi terminata.
146. Il-“kronogramma tar-rapportar” hija d-data u l-ħin tas-sottomissjoni ta' rapport tad-derivattiv partikolari lir-repożitorju tad-data dwar it-tranżazzjonijiet. Japplika bl-istess mod għar-rapporti fil-livell tal-pożizzjoni.
147. Il-“kronogramma tal-eżekuzzjoni” hija d-data u l-ħin meta derivattiv (fil-livell tan-negozju jew tal-pożizzjoni) infetaħ għall-ewwel darba u l-UTI tiegħu nħoloq. Fil-każ tar-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni, dak il-kamp għandu jmtela b'mod simili għall-kamp “Data effettiva”, jiġifieri bid-data tan-negozju li għandu l-kronogramma tal-eżekuzzjoni l-iktar kmieni.
148. Id-“data tal-event” hija ddefinita bħala d-data meta sejtn event partikolari jew meta modifika saret “effettiva” (iktar milli d-data tal-ftehim li d-derivattiv jiġi modifikat). Fil-livell tal-pożizzjoni, dan il-kamp għandu jmtela meta sejtnew avvenimenti jew modifiki rilevanti relatati mal-pożizzjoni. Iktar dettalji huma pprovduti fit-taqsima 3.9.
149. Il-“kronogramma tal-ikklerjar” hija d-data u l-ħin meta negozju jew pożizzjoni jiġu kkljerjati. Fil-livell tal-pożizzjoni, dan il-kamp għandu jiġi rrapportat bl-użu tal-kronogramma tal-eżekuzzjoni tal-pożizzjoni għax iż-żewġ kronogrammi huma mistennija jkunu l-istess għall-pożizzjonijiet.
150. Fil-livell tal-pożizzjoni, il-kamp “Ċentru tal-eżekuzzjoni” għandu jmtela bil-kodiċi MIC (definit mill-ISO 10383) ta' ċentru fejn in-numru l-iktar għoli ta' derivattivi li huma inklużi fil-pożizzjoni rrapportata kienu twettqu.
151. Derivattiv li huwa r-riżultat ta' eżerċizzju PTRR, għandu jiġi rrapportat fil-livell tan-negozju.
152. L-ESMA ttenni li r-rapportar fil-livell tal-pożizzjoni huwa każ tan-negozju differenti mir-rapportar tal-avvenimenti PTRR, it-tnejn b'regoli ta' rapportar differenti. It-tabella t'hawn taht tenfasizza d-differenzi ewlenin bejn iż-żewġ sitwazzjonijiet:

**TABELLA 7**

| #                         | Compression (or other PTRR techniques)                                                                                                                      | Reporting at position level                                                                                                                     |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Applicability</b>      | Risk-reduction services (both cleared and uncleared derivatives)                                                                                            | CCP netting (both ETD and OTC) + reporting of CFDs                                                                                              |
| <b>2.154 Level</b>        | Derivatives entering the compression - <u>trade or position</u> , as applicable; derivatives resulting from a PTRR event are reported at <u>trade</u> level | Initial reports (action type NEWT or POSC) at <u>trade</u> level, resulting position and subsequent lifecycle events - at <u>position</u> level |
| <b>Linking of reports</b> | 2.5 PTRR ID                                                                                                                                                 | 2.4 Subsequent position UTI                                                                                                                     |

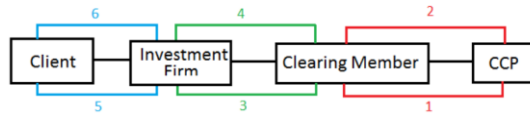
### 3.8 Ir-rapportar tad-derivattivi fiċ-ċentru

153. Il-kuntratti ETD huma kuntratti tad-derivattivi li huma soġġetti għar-regoli ta' ċentru tan-negozjar (kif definit fl-Artikolu 4(1)(24) tad-Direttiva 2014/65/UE) u jitwettqu f'konformità ma' daww ir-regoli. Għall-iskop tar-rapportar tad-"derivattivi fiċ-ċentru", jitqiesu wkoll pjattaformi ta' skambju simili barra mill-UE. Ir-regoli taċ-ċentru tan-negozjar jipprovdu l-eżekuzzjoni u l-ipproċessar tal-kuntratt fiċ-ċentru tan-negozjar u l-ikklerjar sussegwenti fil-kamra tal-ikklerjar ta' kontroparti ċentrali (CCP) fi żmien jum ta' negozju wieħed wara l-eżekuzzjoni.
154. Sabiex l-awtoritajiet ikunu jistgħu jidentifikaw u janalizzaw il-pożizzjonijiet tar-riskju, il-kontropartijiet li jgħorru r-riskju malli l-kuntratt ikun konkluż għandhom ikunu jistgħu jiġu identifikati b'mod ċar. Skont il-mudell ta' kklerjar ċentrali, mal-ikklerjar, ir-riskju jkun fuq il-membri tal-ikklerjar (CM) fil-konfront tas-CCP u fuq il-klijent tas-CM fil-konfront tas-CM. Għal din ir-raġuni, il-partijiet li ġejjin għandhom l-obbligi ta' rapportar tal-EMIR:
- Is-CCP li tikklerja l-kuntratt tad-derivattiv.
  - Il-membri tal-ikklerjar tas-CCP li qed jikklerjaw il-kuntratt tad-derivattiv.
  - Id-ditti tal-investiment MiFID involuti fil-katina tal-kummerċ fi kwalunkwe mument li jgħorru r-riskju li jirriżulta mid-derivattiv minhabba r-relazzjoni kuntrattwali tiegħu mal-kontropartijiet tagħhom (b'mod partikolari, mal-membri tal-ikklerjar).
  - Partijiet oħra li ma jaqgħu fl-ebda waħda mill-kategoriji ta' hawn fuq u li jieħdu r-riskju li jirriżulta mid-derivattiv, hliet meta jiġu eżentati minhabba l-istatus tagħhom.
155. Jekk waħda minn dawn il-partijiet għandha iktar minn rwol wieħed (eż. id-ditta tal-investiment hija wkoll il-membri tal-ikklerjar), għandha tippreżenta rapport

wieħed li jidentifika r-rwoli kollha applikabbli fil-kampijiet rilevanti, m'hemmx għalfejn tirrapporta separatament għal kull rwol.

Eżempji:

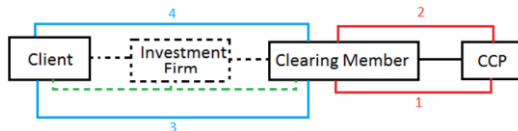
Xenarju 1: Id-ditta tal-investment iġġorr ir-riskju fir-rigward tas-CM u, għalhekk, hija hi stess kontroparti. F'dan il-każ għandhom jiġu ppreżentati r-rapporti li ġejjin:



**TABELLA 8**

| Report | Entity responsible for reporting | UTI   | Report tracking number | Counterparty 1 (Reporting counterparty) | Counterparty 2  | Broker ID       | Clearing member | Direction | Venue of execution | Cleared | Central counterparty |
|--------|----------------------------------|-------|------------------------|-----------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|--------------------|---------|----------------------|
| 1      | Clearing member                  | A0001 | 102030                 | Clearing member                         | CCP             |                 | Clearing member | BYER      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 2      | CCP                              | A0001 | 102030                 | CCP                                     | Clearing member |                 | Clearing member | SLLR      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 3      | Investment firm                  | B0002 | 102030                 | Investment firm                         | Clearing member | Investment firm | Clearing member | BYER      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 4      | Clearing member                  | B0002 | 102030                 | Clearing member                         | Investment firm | Investment firm | Clearing member | SLLR      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 5      | Client                           | C0003 | 102030                 | Client                                  | Investment firm | Investment firm | Clearing member | BYER      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 6      | Investment firm                  | C0003 | 102030                 | Investment firm                         | Client          | Investment firm | Clearing member | SLLR      | MIC                | Y       | CCP                  |

Xenarju 2: Id-ditta tal-investment ma iġġorr l-ebda riskju fil-konfront tal-membri tal-ikklerjar għax, skont l-arrangamenti legali, il-klijent iġorr direttament ir-riskju fil-konfront tal-membri tal-ikklerjar, malli dan tal-aħħar jaċċetta l-kuntratt għall-ikklerjar.



**TABELLA 9**

| Report | Entity responsible for reporting | UTI   | Report tracking number | Counterparty 1 (Reporting counterparty) | Counterparty 2  | Broker ID       | Clearing member | Direction | Venue of execution | Cleared | Central counterparty |
|--------|----------------------------------|-------|------------------------|-----------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|--------------------|---------|----------------------|
| 1      | Clearing member                  | A0001 | 102030                 | Clearing member                         | CCP             |                 | Clearing member | BYER      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 2      | CCP                              | A0001 | 102030                 | CCP                                     | Clearing member |                 | Clearing member | SLLR      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 3      | Client                           | B0002 | 102030                 | Client                                  | Clearing member | Investment firm | Clearing member | BYER      | MIC                | Y       | CCP                  |
| 4      | Clearing member                  | B0002 | 102030                 | Clearing member                         | Client          | Investment firm | Clearing member | SLLR      | MIC                | Y       | CCP                  |

156. Meta jseħh give-up mid-ditta tal-investment lill-membri tal-ikklerjar fid-data tal-għeluq tar-rapportar T+1 mingħajr l-ebda tibdil fit-termini ekonomiċi tad-derivattiv originali, id-derivattiv għandu jiġi rapportat fl-istat ta' wara l-give-up tiegħu. Dan ifisser li d-ditta tal-investment ma iġġorr l-ebda riskju fil-konfront tal-membri tal-ikklerjar, għalhekk il-klijent iġorr direttament ir-riskju fil-konfront tal-membri tal-ikklerjar li miegħu daħal fl-arrangament tal-ikklerjar. L-ESMA ttenni wkoll li l-

avvenimenti rilevanti li jaffettwaw id-derivattivi rrapportati fil-livell tan-negożju għandhom jiġu rrapportati kif xieraq (eż. l-allokazzjoni tan-negożji).

157. L-eżekuzzjonijiet parzjali għandhom jiġu rrapportati separatament, għax il-parametri u l-kontropartijiet ikunu differenti.
158. In-Numru tal-Intraċċar tar-Rapport (RTN) huwa kodiċi uniku mogħti lill-eżekuzzjoni u komuni għal grupp ta' rapporti relatati mal-istess eżekuzzjoni. Huwa kamp obligatorju kondizzjonali għat-tip ta' azzjoni "POSC" fil-livell tan-negożju (meħtieġ meta n-negożju jitwettagħ f'ċentru tan-negożjar). L-RTN m'għandux jimtela fil-livell tal-pożizzjoni.
159. M'hemm l-ebda rabta one-to-one bejn il-Kodiċi tal-Identifikazzjoni tat-Tranżazzjoni taċ-Ċentru tan-Negożjar (TVTIC) meħtieġ skont l-MiFIR u n-Numru tal-Intraċċar tar-Rapport (RTN). TVTIC huwa kodiċi tal-identifikazzjoni tat-tranżazzjoni individwali għal kull tranżazzjoni li tirriżulta mill-eżekuzzjoni sħiħa jew parzjali ta' ordni mifruxa kemm lill-partijiet li qed jixtru kif ukoll li qed ibigħu. L-RTN huwa numru uniku mogħti lill-eżekuzzjoni u komuni fost grupp ta' rapporti relatati mal-istess eżekuzzjoni, sabiex jippermetti l-identifikazzjoni tar-rapporti relatati mal-istess eżekuzzjoni. Minhabba l-fatt li internalizzatur sistemiku mhuwiex meqjus bħala ċentru tan-negożjar skont id-Direttiva 2014/65/UE (MIFID II) u RTN jiġi ġġenerat minn ċentru tan-negożjar, il-mili tal-kamp RTN meta n-negożji huma konklużi fuq SI mhux meħtieġ.
160. Id-ditti tal-investment, il-membri tal-ikklerjar jew is-CCPs għandhom jipprovdu lill-kontropartijiet li jirrapportaw l-RTNs rispettivi. Bl-istess mod, il-kontropartijiet li jirrapportaw għandhom jittirażmettu l-RTNs lill-kontropartijiet tagħhom biex jippermettu li jwettqu l-obbligi ta' rapportar tagħhom.
161. Ir-rapportar tal-RTN għas-CFD (fil-każ li jitwettqu f'ċentru u meta grupp ta' CFDs huma relatati mal-istess eżekuzzjoni) isegwi l-istess regoli deskritti hawn fuq.
162. L-Identifikatur Uniku tat-Tranżazzjoni (UTI) huwa kodiċi uniku ta' derivattiv bejn żewġ kontropartijiet. Par kontropartijiet għandhom jużaw UTI speċifiku għal derivattiv uniku wieħed, u m'għandhomx jerġgħu jużaw l-istess UTI biex jirrapportaw kwalunkwe derivattiv ieħor skont l-EMIR. L-istess prinċipju japplika għall-UTIs iġġenerati għad-derivattivi rrapportati fil-livell tal-pożizzjoni. Il-UTI għandu jkun identiku fir-rapporti taż-żewġ kontropartijiet li jidhlu f'derivattiv. Iktar dettalji dwar l-ID Uniku tat-Tranżazzjoni (UTI) huma pprovduti fit-taqsima 3.11.
163. Il-kampijiet tal-kronogrammi għandhom jimtlew kif ġej:
  - a. Il-kronogramma tal-eżekuzzjoni għandha tikkorrispondi għall-ħin tal-eżekuzzjoni fiċ-ċentru tan-negożjar.
  - b. Il-kronogramma tal-ikklerjar għandha tiġi rrapportata bħala l-ħin li fih is-CCP legalment ħadet ir-responsabbiltà tal-ikklerjar tan-negożju. Meta l-ikklerjar iseħħ bl-użu tal-mudell ta' offerta miftuħa, il-kronogramma tal-ikklerjar u l-kronogramma tal-eżekuzzjoni użata huma mistennija li jkunu l-istess. Madankollu, jekk l-ikklerjar iseħħ bl-użu tan-novazzjoni, iż-żewġ kronogrammi jistgħu jkunu differenti.

164. Sakemm ma jkunx miftiehem mod ieħor bejn il-partijiet, ditta ta' investiment mhi mistennija li tippreżenta l-ebda rapport dwar il-valur tal-kollateral kif ukoll l-ebda modifika jew terminazzjoni sussegwenti tal-kuntratt tad-derivattiv konkluz meta l-proċess tal-kollateralizzazzjoni jseħħ permezz ta' arrangamenti diretti bejn il-klijent (kontroparti 1) u l-membri tal-ikklerjar.
165. Fil-livell tan-negozju u fil-livell tal-pożizzjoni, għan-negozji tad-derivattivi fiċ-ċentru, ir-rapportar tal-istess ġurnata tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja mhuwiex obligatorju, huwa fakultattiv. Fil-livell tan-negozju u fil-livell tal-pożizzjoni, għad-derivattivi fiċ-ċentru, l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja kollha jistgħu jiġu rrapportati fl-aħħar tal-ġurnata billi jirriflettu fuq l-istat tad-derivattiv sa dak il-punt.
166. Eżempju ta' derivattiv fiċ-ċentru wara l-RTS dwar ir-rapportar: Istituzzjoni ta' kreditu Portugiża A tibgħat modifika lil pożizzjoni fiċ-ċentru b'kontroparti ta' kumpanija ta' investiment Spanjola B, minħabba avveniment korporattiv li jseħħ fl-ekwità sottostanti. Ir-rapport huwa relatat ma' pożizzjoni ta' kuntratt tal-futuri nnegozjat fiċ-ċentru tan-negozjar X fuq dividendi fuq azzjoni ta' kumpanija Netherlandiża. Il-pożizzjoni hi kollateralizzata u s-saldu se jkun fi flus kontanti.
167. Mhux il-kampijiet meħtieġa kollha ġew inklużi.

| TABELLA 10 IR-RAPPORTAR TAD-DERIVATTIVI FIĊ-ĊENTRU |                                               |                      |
|----------------------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------|
| Nru                                                | Kamp                                          | Eżempju              |
| Tabella 1                                          |                                               |                      |
| 1                                                  | Kronogramma tar-rapportar                     | 2021-12-02T09:35:00Z |
| 2                                                  | ID tal-entità li tippreżenta r-rapport        | LEI A                |
| 3                                                  | Entità responsabbli mir-rapportar             | LEI A                |
| 4                                                  | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)    | LEI A                |
| 5                                                  | Natura tal-kontroparti 1                      | F                    |
| 6                                                  | Settur korporattiv tal-kontroparti 1          | CDTI                 |
| 7                                                  | Livell limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1 | VERU                 |
| 8                                                  | It-tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                 |
| 9                                                  | Kontroparti 2                                 | LEI B                |

|           |                                                                         |                      |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------|----------------------|
| 11        | Natura tal-kontroparti 2                                                | F                    |
| 12        | Settur korporattiv tal-kontroparti 2                                    | INVF                 |
| 14        | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2                                 | FALZ                 |
| 16        | Membru tal-ikklerjar                                                    | LEI A                |
| 17        | Direzzjoni                                                              | BYER                 |
| 20        | B'rabta diretta mal-attività kummerċjali jew mal-finanzjament tat-teżor | FALZ                 |
| Tabella 2 |                                                                         |                      |
| 1         | UTI                                                                     | ABCDE24680TTTTT22222 |
| 7         | ISIN                                                                    | DE000C5XXXXX         |
| 9         | Klassifikazzjoni tal-prodott                                            | FFVCSX               |
| 10        | Tip ta' kuntratt                                                        | FUTR                 |
| 11        | Klassi tal-assi                                                         | EQUI                 |
| 13        | Tip ta' identifikazzjoni tas-sottostanti                                | I                    |
| 14        | Identifikazzjoni tas-sottostanti                                        | NL001154XXXX         |
| 19        | Munita tas-saldu 1                                                      | EUR                  |
| 21        | Ammont tal-valwazzjoni                                                  | 205,100,00           |
| 22        | Munita tal-valwazzjoni                                                  | EUR                  |
| 23        | Kronogramma tal-valwazzjoni                                             | 2021-12-02T09:59:00Z |
| 24        | Metodu tal-valwazzjoni                                                  | CCPV                 |
| 26        | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral                                  | VERU                 |

|     |                                            |                         |
|-----|--------------------------------------------|-------------------------|
| 27  | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral        | 1814145_1145_BSC040XXXX |
| 30  | Obbligu tal-ikklerjar                      | UKWN                    |
| 31  | Ikklerjat                                  | IVA                     |
| 32  | Kronogramma tal-ikklerjar                  | 2021-12-01T00:59:00Z    |
| 33  | Kontroparti ċentrali                       | LEI tas-CCP             |
| 37  | Intragrupp                                 | FALZ                    |
| 38  | PTRR                                       | FALZ                    |
| 41  | Ċentru tal-eżekuzzjoni                     | MIC X                   |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                | 2021-12-01T00:30:00Z    |
| 43  | Data effettiva                             | 2021-11-30              |
| 44  | Data ta' skadenza                          | 2021-12-17              |
| 47  | Tip ta' konsenja                           | FLUS KONTANTI           |
| 48  | Prezz                                      | 0.42                    |
| 49  | Munita tal-prezz                           | EUR                     |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1          | 1554000                 |
| 56  | Munita nozzjonali 1                        | EUR                     |
| 60  | Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 1 | 3700000                 |
| 151 | Tip ta' azzjoni                            | MODI                    |
| 152 | Tip ta' event                              | Event Korporattiv       |
| 153 | Data tal-event                             | 2021-12-02              |
| 154 | Livell                                     | PSTN                    |

### 3.9 Ir-rapportar puntwali tal-konklużjoni, tal-modifika u tat-terminazzjoni ta' derivattiv

168. L-Artikolu 9(1) tal-EMIR jipprevedi li “Il-kontropartijiet u l-kontropartijiet ċentrali għandhom jiżguraw li d-dettalji ta’ kwalunkwe kuntratt tad-derivati li jkunu kkonkludew u kwalunkwe modifika jew terminazzjoni tal-kuntratt jiġu rrapportati lil repożitorju kummerċjali (...)”. Barra minn hekk, id-dettalji rilevanti għandhom jiġu rrapportati “mhux iżjed tard mill-jum tax-xogħol wara l-konklużjoni, il-modifika jew it-terminazzjoni tal-kuntratt.”

#### 3.9.1 Konklużjoni ta' derivattiv

169. Kull konklużjoni ta' derivattiv għandha tiġi rrapportata lil TR. Jekk derivattiv li huwa konkluż jiġi sussegwentement terminat, il-kontropartijiet jew l-ERR, kif applikabbli, wara li jirrapportawh bit-tip ta' azzjoni “Ġdid” għandhom jirrapportawh bit-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni”.

170. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-konklużjoni ta' derivattiv anki jekk it-terminazzjoni ta' dak id-derivattiv isseħħ qabel id-data tal-għeluq tar-rapportar (eż. għad-derivattivi tal-istess ġurnata). F'tali każ, il-kontroparti għandha tibgħat, fl-istess data tal-għeluq tar-rapportar, żewġ rapporti: wieħed bit-tip ta' azzjoni “Ġdid” u wieħed bit-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni”. Jekk id-derivattiv huwa terminat fl-istess ġurnata minhabba l-inklużjoni f'pożizzjoni, il-kontroparti għandha tibgħat biss rapport wieħed għal dak id-derivattiv, bit-tip ta' azzjoni “Komponent ta' pożizzjoni”.

171. Jekk id-derivattiv oriġinali ġie inkluż f'pożizzjoni u għalhekk ġie rrapportat bit-tip ta' azzjoni “Komponent ta' Pożizzjoni”, u sussegwentement jiġi tterminat, il-kontropartijiet m'għandhomx jibagħtu rapport bit-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni” għad-derivattiv oriġinali, iżda l-kontropartijiet għandhom jibagħtu rapport bit-tip ta' azzjoni “Modifika” għall-pożizzjoni li fiha jkun ġie inkluż id-derivattiv oriġinali sabiex dan id-derivattiv jitneħħa mill-pożizzjoni.

172. It-tip ta' azzjoni “Żball” għandu jintuża biss biex jiġihassru d-derivattivi li qatt ma daħlu fis-seħħ jew li ma jaqgħux fil-kamp ta' applikazzjoni tal-obbligu ta' rapportar skont l-EMIR. Għalhekk, fix-xenarju speċifiku fejn il-kontropartijiet jaqblu li jikkonkludu derivattiv li huwa kundizzjonali fuq ir-registrazzjoni mas-CCP u s-CCP tirrifjuta dak id-derivattiv, il-kontropartijiet għandhom jiterminaw id-derivattiv bit-tip ta' azzjoni “Żball” peress li l-kundizzjoni miftiehma biex il-kuntratt isseħħ ma ġietx issodisfata, għalhekk id-derivattiv qatt ma daħal fis-seħħ.

#### 3.9.2 Modifika jew korrezzjoni ta' derivattiv

173. Modifika għal derivattiv tinkludi r-rapportar tat-tipi ta' azzjoni li ġejjin: “Modifika” u “Korrezzjoni”. L-iskeda ta' żmien għar-rapportar hija l-istess bħal tal-konklużjoni ta' derivattiv, jiġifieri li mill-mument meta modifika tkun effettiva, din issir rapportabbli.

174. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw biss il-modifiki li jkunu seħħew, jiġifieri m'għandhomx jirrapportaw il-modifiki li jkunu ġew miftiehma iżda li se jsiru effettivi fil-futur. Biex jingħata eżempju, jekk il-kontropartijiet jaqblu li jemendaw innozzjonali f'data futura, din l-emenda għandha tiġi rrapportata biss ladarba tintlaħaq id-data miftiehma (id-data effettiva tal-emenda).
175. Fir-rigward tal-korrezzjoni, din għandha tiġi rrapportata malli tiġi identifikata d-data rrapportata b'mod inkorrett.
176. Mhuwiex meħtieġ li jintbagħat rapport ta' korrezzjoni jekk, wara modifika ta' derivattiv, kontroparti tkun introduċiet informazzjoni inkorretta fis-sistemi interni tagħha biss iżda ma rrapportatx tali data inkorretta lit-TR. F'tali każijiet dik il-kontroparti għandha tibgħat biss ir-rapport tal-modifika li fih id-data finali u korretta (jiġifieri, m'għandhiex tibgħat ir-rapport ta' modifika bid-data żbaljata u imbagħad il-korrezzjoni).

### 3.9.3 Rapportar tal-aġġornamenti tal-marġni u tal-valwazzjoni

177. Fil-każ ta' aġġornamenti tal-valwazzjoni, il-kontropartijiet għandhom jibagħtu valwazzjonijiet ta' kuljum sa tmiem il-jum ta' xogħol wara d-data tal-valwazzjoni u jimlew id-data tal-valwazzjoni fil-kamp "Data tal-event". Għandu jkun l-istess għall-parti tad-data tal-kamp "Kronogramma tal-valwazzjoni".
178. L-aġġornamenti tal-marġni għandhom jintbagħtu ta' kuljum u l-kontropartijiet għandhom jimlew il-kamp "Data tal-event" bid-data li għaliha qed jiġi rrapportat l-aġġornament tal-marġni (jiġifieri r-rapport tal-aġġornament tal-marġni għandu jirrifletti l-istat tal-marġni fl-aħħar ta' dik il-ġurnata). L-aġġornamenti tal-marġni għandhom jiġu rrapportati meta jsiru effettivi, jiġifieri fid-data tas-saldu mistennija, u għandhom jinkludu kwalunkwe marġni li jkun fi tranżitu u saldu pendenti, mingħajr ma jitqiesu fallimenti tas-saldu temporanji.
179. Fil-każ speċifiku ta' marġni mħallsa minn qabel lil CCP ta' portafoll ta' negozji kklerjati, dawn għandhom jiġu rrapportati f'T+1 tal-konklużjoni tal-ewwel derivattiv applikabbli fil-portafoll relatat (marbuta b'kodiċi tal-portafoll), minflok fil-jum ta' wara d-data li fiha jkun ġie ppreżentat il-kollateral.
180. B'mod iktar ġenerali, l-ebda marġni m'għandhom jiġu rrapportati jekk l-ebda derivattiv kopert minn dawk il-marġni ma ġie rrapportat qabel.

### 3.9.4 Terminazzjoni ta' derivattiv

181. Il-kontropartijiet m'għandhomx jibagħtu rapport bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" meta derivattiv jilhaq id-data ta' maturità tiegħu u, għalhekk, ma jkunx għadu pendenti. Malli d-data ta' maturità tintlaħaq, id-derivattiv jiġi awtomatikament meqjus bħala mhux pendenti.
182. Jekk il-kontropartijiet jaqblu li jitterminaw derivattiv qabel id-data ta' maturità jew li jitterminaw id-derivattiv b'terminu miftuħ, huma għandhom:

- a. Jippreżentaw rapport bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" fejn id-data ta' terminazzjoni miftiehma tkun għall-istess ġurnata tal-avviż tat-terminazzjoni, jew
  - b. Jippreżentaw rapport bit-tip ta' azzjoni "Modifika" fejn id-data ta' terminazzjoni miftiehma tkun il-ġurnata ta' wara jew iktar tard. F'dan il-każ, il-kontropartijiet għandhom jimmodifikaw id-data tal-maturità kif xieraq.
183. Il-kontropartijiet m'għandhomx jibagħtu rapport bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" jekk id-data ta' terminazzjoni taqa' mad-data tal-maturità. Dan jinkludi, eż. meta kontroparti tħaddem opzjoni fid-data tal-maturità.
184. Fil-każ ta' pożizzjoni nnettjata, il-kontropartijiet jistgħu jiddeċiedu li jzommuha miftuħa u jirrapportaw il-valwazzjoni kuljum jew jiterminaw tali pożizzjoni (u jirrapportaw bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u UTI ġdid fil-każ li tkun teħtieġ tinfetaħ mill-ġdid). Iż-żewġ kontropartijiet għandhom jirrapportaw b'mod konsistenti. Dan l-aspett huwa kopert f'iktar dettall fit-taqsim 3.7.

#### Data tal-event

185. It-Tabella 11 tispeċifika x'għandu jiġi rrapportat fil-kamp "Data tal-event" għal kull tip ta' azzjoni. Id-data tal-event, skont id-definizzjoni, tindika wkoll x'inhu skattatur għar-rapportar, eż. id-data tal-valutazzjoni fil-każ ta' aġġornamenti ta' valwazzjoni. Ir-rapporti attwali għandhom jiġu ppreżentati sa tmiem il-jum ta' xogħol wara d-data tal-event.

| TABELLA 11               |                                                                                                                             |
|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tip ta' azzjoni          | Data tal-event                                                                                                              |
| Ġdid                     | Id-data tal-konklużjoni tad-derivattiv jew id-data tal-ħolqien ta' pożizzjoni                                               |
| Modifika                 | Id-data effettiva tal-modifika                                                                                              |
| Korrezzjoni              | Id-data minn meta l-korrezzjoni għandha tapplika (tipikament id-data li għaliha giet irrapportata data żbaljata preċedenti) |
| Terminazzjoni            | Id-data li fiha t-terminazzjoni ssir effettiva                                                                              |
| Żball                    | Id-data tar-rapportar ta' Żball                                                                                             |
| Ftuħ mill-ġdid           | Id-data tar-rapportar ta' Ftuħ mill-ġdid                                                                                    |
| Valwazzjoni              | Data tal-valwazzjoni                                                                                                        |
| Komponent ta' pożizzjoni | Id-data tal-konklużjoni tad-derivattiv u tal-inkluzjoni tiegħu fil-pożizzjoni                                               |

**TABELLA 11**

| Tip ta' azzjoni        | Data tal-event                       |
|------------------------|--------------------------------------|
| Aġġornament tal-marġni | Data tas-saldu mistennija tal-marġni |

186. Fil-każ meta, terminazzjoni bikrija datata fil-futur tiġi miftiehma, il-modifika għandha tiġi rrapportata sal-aħħar tal-jum ta' xogħol wara d-data tal-ftehim. Tali rapport tal-modifika għandu jinkludi d-data tal-ftehim bħala d-“Data tal-event” u d-data futura miftiehma fil-kamp tad-“Data ta' skadenza”.
187. Id-data tal-event għandha titqies mit-TRS sabiex jinbena r-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju ta' derivattiv. Iktar dettalji f'dan ir-rigward huma inklużi fit-taqsima 6.1.

### 3.10 Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjonijiet

188. Hawn taħt, l-ESMA tipprovdi mmappjar bejn l-avvenimenti tan-negozju u t-tipi ta' azzjoni u t-tipi ta' eventi korrispondenti li l-kontropartijiet għandhom jużaw f'rabta mal-avvenimenti rispettivi.
189. It-Tabella 12 fiha kolonna “Rapportabbli?” li tipprovdi kjarifiki dwar ir-rapportabbiltà ta' kull avveniment. Madankollu, bħala regola ġenerali, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw kwalunkwe negozju ġdid li jaqa' fil-kamp ta' applikazzjoni tar-rapportar u kwalunkwe modifika li taffettwa d-dettalji rrapportati.
190. Uħud mill-avvenimenti tan-negozju (eż. l-inadempjenza ta' kontroparti oħra) jistgħu jvarjaw minn każ ġenerali pprezentat fit-tabella. Għalhekk, is-sekwenza reali tal-eventi rapportabbli tista', f'xi każijiet, tvarja mill-eżempji mogħtija u għandha dejjem tirrifletti l-avvenimenti fil-ħajja reali kemm jista' jkun.
191. Meta l-eventi ta' terminazzjoni bikrija jiġu rrapportati (minħabba eż. terminazzjoni sħiħa jew eżerċizzju bikri tal-kuntratt tad-derivattiv), il-kontropartijiet għandhom jagħzlu t-tip ta' azzjoni li jista' jiġi rrapportat abbażi tad-data effettiva tal-event. Jekk id-data tat-terminazzjoni miftiehma hija għall-istess ġurnata bħan-notifika tat-terminazzjoni, il-kontropartijiet għandhom jużaw it-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni”. Jekk l-event miftiehem iseħħ fil-futur, il-kontropartijiet għandhom jużaw it-tip ta' azzjoni “Modifika” u jagġornaw id-data tal-maturità biex tirrifletti d-data tat-terminazzjoni li ġiet miftiehma.

**TABELLA 12**

| Kategorija                  | Avveniment tan-Negozju              | Dettall                                                                         | Rapport abbli?                              | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Kumment |
|-----------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|---------------|---------|
| Emendi u Kanċellazzjonijiet | Emenda (jiġifieri Korrezzjoni)      | L-emendar tad-dettalji li oriġinarjament iddaħħlu b'mod żbaljat                 | Iva, jekk jaffettwa id-dettalji rrapportati | Korrezzjoni     |               |         |
|                             | Emenda Ekonomika ment Immaterjali   |                                                                                 | Iva, jekk taffettwa d-dettalji rrapportati  | Modifika        | Negozju       |         |
|                             | Emenda Ekonomika ment Materjali     |                                                                                 | Iva, jekk taffettwa d-dettalji rrapportati  | Modifika        | Negozju       |         |
|                             | Kanċellazzjoni                      | Negozju rreġistrat bi żball u kkanċellat sussegwentement.                       | Iva                                         | Żball           |               |         |
|                             | Kanċellazzjoni rrapportata bi żball | In-negozju ġie kkanċellat bi żball u jeħtieġ li jinfetaħ mill-ġdid              | Iva                                         | Ftuħ mill-ġdid  |               |         |
| Eventi ta' negozju          | Negozju Ġdid                        |                                                                                 | Iva                                         | Ġdid            | Negozju       |         |
|                             | Żieda                               | Ftehim imwettaq b'mod bilaterali biex jiżdied in-nozzjonali fuq it-tranzazzjoni | Iva                                         | Modifika        | Negozju       |         |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negozju           | Dettall                                                                            | Rapport abbli? | Tip ta' azzjoni        | Tip ta' event         | Kumment                                               |
|------------|----------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------|
|            | Terminazzjoni Shiha              | Xoljiment Shiha                                                                    | Iva            | Terminazzjoni/Modifika | Terminazzjoni bikrija |                                                       |
|            | Terminazzjoni Parzjali           | Xoljiment Parzjali                                                                 | Iva            | Modifika               | Terminazzjoni bikrija |                                                       |
|            | Allokazzjoni                     | Negozju "fi blokok" li orġinarjament ma kienx allokati għall-partijiet prinċipali. | Iva            | Terminazzjoni/Modifika | Allokazzjoni          | Modifika applikabbli għall-alkokazzjoni jiet parzjali |
|            |                                  | Negozji allokati sussegwenti                                                       | Iva            | Gdid                   | Allokazzjoni          |                                                       |
|            | Pożizzjonijiet/Negozji Kklerjati | Negozju Bilaterali Originali (in-negozju "alfa")                                   | Iva            | Terminazzjoni          | Ikklerjar             |                                                       |
|            |                                  | Pożizzjoni Kklerjata (negozji "beta" u "gamma")                                    | Iva            | Gdid                   | Ikklerjar             |                                                       |
|            | Novazzjoni Shiha                 | Il-parti li tiftal                                                                 | Iva            | Terminazzjoni+Gdid     | Intervent             | In-negozju mal-kontroparti oriġinali huwa terminat    |
|            |                                  | Intervent                                                                          | Iva            | Gdid                   | Intervent             |                                                       |
|            |                                  | Frug                                                                               | Iva            | Terminazzjoni          | Intervent             |                                                       |
|            | Novazzjoni Parzjali              | Il-parti li tiftal                                                                 | Iva            | Modifika+Gdid          | Intervent             |                                                       |
|            |                                  | Intervent                                                                          | Iva            | Gdid                   | Intervent             |                                                       |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negozju      | Dettall                  | Rapport abbli?                                                     | Tip ta' azzjoni        | Tip ta' event | Kumment |
|------------|-----------------------------|--------------------------|--------------------------------------------------------------------|------------------------|---------------|---------|
|            |                             | Frug                     | Iva                                                                | Modifika               | Intervent     |         |
|            | Ezerċizzju tal-Opzjoni      | Ezerċizzju Shiħ          | Biss jekk l-ezerċizzju jseħħ qabel l-iskadenza originali           | Terminazzjoni/Modifika | Ezerċizzju    |         |
|            |                             | Ezerċizzju Parzjali      | Biss jekk l-ezerċizzju jseħħ qabel l-iskadenza originali           | Modifika               | Ezerċizzju    |         |
|            | Give-up/Take-up             | Il-parti li tiftal       | Biss jekk l-event iseħħ wara d-data tal-għeluq tar-rapportar (T+1) | Modifika               | Intervent     |         |
|            |                             | Intervent                |                                                                    | Gdid                   | Intervent     |         |
|            |                             | Frug                     |                                                                    | Terminazzjoni          | Intervent     |         |
|            | Trasferiment tal-Pożizzjoni | Il-parti li tiftal       | Biss jekk l-event iseħħ wara d-data tal-għeluq tar-rapportar (T+1) | Modifika               | Intervent     |         |
|            |                             | Intervent                |                                                                    | Gdid                   | Intervent     |         |
|            |                             | Frug                     |                                                                    | Terminazzjoni          | Intervent     |         |
|            | Ezerċizzju ta' Swapzjoni    | Ezerċizzju ta' Swapzjoni | Biss jekk l-ezerċizzju jseħħ qabel l-                              | Terminazzjoni          | Ezerċizzju    |         |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negożju | Dettall                                                               | Rapport abbli?      | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Kumment                                                                 |
|------------|------------------------|-----------------------------------------------------------------------|---------------------|-----------------|---------------|-------------------------------------------------------------------------|
|            |                        |                                                                       | iskadenza oriġinali |                 |               |                                                                         |
|            |                        | Is-Swap li Jirriżulta mill-eżerċizzju ta' Swapzjoni.                  | Iva                 | Ġdid            | Eżerċizzju    |                                                                         |
|            | Event ta' Kompresjoni  | Negożju Oriġinali - Terminat                                          | Iva                 | Terminazzjoni   | PTRR          |                                                                         |
|            |                        | Negożju Oriġinali - Emenda                                            | Iva                 | Modifika        | PTRR          |                                                                         |
|            |                        | In-negożju li jirriżulta ġdid                                         | Iva                 | Ġdid            | PTRR          |                                                                         |
|            | Saldu fi Flus Kontanti | Is-saldu attwali fi flus kontanti tat-tariffi, tal-pagamenti, eċċ     | Le                  |                 |               | It-tariffi ta' xoljiment huma rrapportati fil-messaġġ tat-terminazzjoni |
|            | Maturità tal-Kuntratt  | Il-kuntratt tad-derivattiv li jiskadi fid-data tal-maturità oriġinali | Le                  |                 |               | Il-kuntratt huwa aġġornat awtomatikament għal stat mhux pendenti mit-TR |
|            | Kaskata                | Tqassim ta' pożizzjoni f'livell iktar granulari: il-pożizzjoni        | Iva                 | Terminazzjoni   | Negożju       |                                                                         |

**TABELLA 12**

| Kategorija        | Avveniment tan-Negozju         | Dettall                                                                      | Rapport abbli?                                                                    | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Kumment |
|-------------------|--------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------|---------|
|                   |                                | inizjali fi, eż. kuntratt annwali                                            |                                                                                   |                 |               |         |
|                   |                                | Pożizzjonijiet li jirriżultaw fi, eż. kuntratti trimestrali                  | Iva                                                                               | Ġdid            | Negozju       |         |
|                   | Qsim                           | Id-diviżjoni ta' negozju u l-allokazzjoni tiegħu għal diversi pożizzjonijiet | Iva                                                                               | Terminazzjoni   | Allokazzjoni  |         |
|                   |                                | Il-ħolqien/l-emendar tal-pożizzjonijiet affettwati                           | Iva                                                                               | Ġdid/Modifika   | Allokazzjoni  |         |
| Tibdil intrinsiku | L-amortizzament tan-Nozzjonali | Tibdil fin-nozzjonali matul in-negozju.                                      | Le (l-iskeda tal-amortizzament hija diġà rrapportata fil-konklużjoni tan-negozju) |                 |               |         |
|                   | Resets tad-Dividendi           |                                                                              | Le                                                                                |                 |               |         |
|                   | Resets tal-Ekwità              |                                                                              | Le                                                                                |                 |               |         |
|                   | Resets tar-Rata                | Tibdil fir-rata varjabbli ta' negozju                                        | Le                                                                                |                 |               |         |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negozju | Dettall                                                                                                   | Rapport abbli?                                                                          | Tip ta' azzjoni        | Tip ta' event                 | Kumment                                                                                                  |
|------------|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------|------------------------|-------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Oħrajn     | Eventi ta' suċċessjoni | Il-kontroparti l-oħra tigi sostitwita                                                                     | Bidla fl-LEI tal-kontroparti minħabba eventi korporattivi hija koperta fit-taqsima 3.14 |                        |                               |                                                                                                          |
|            |                        | L-entità referenzjarja speċifikata fit-tranżazzjoni tigi sostitwita minn entità oħra.                     | Iva                                                                                     | Modifika               | Event Korporattiv             |                                                                                                          |
|            | Eventi ta' Kreditu     | Inadempjenza fuq tranżazzjoni eż. inadempjenza ta' falliment/ristrutturar/obbligu tal-kontroparti l-oħra. | Iva                                                                                     | Modifika/Terminazzjoni | Negozju/Terminazzjoni Bikrija | Is-sekwenza eżatta tal-avvenimenti rapportabli se tiddependi mid-dettalji ta' kull proċess ta' falliment |
|            |                        | Inadempjenza eż. inadempjenza ta' falliment/ristrutturar/obbligu ta'                                      | Iva                                                                                     | Modifika/Terminazzjoni | Event ta' Kreditu             | It-tip ta' azzjoni jiddependi mir-riżultat tal-avveniment (in-                                           |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negozju   | Dettall                                                             | Rapport abbli?                                                                                            | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event     | Kumment                                                                               |
|------------|--------------------------|---------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
|            |                          | entità referenzjarja.                                               |                                                                                                           |                 |                   | negozju jiġi terminat jew, eż. il-fattur tal-indiċi jeħtieġ li jiġi aġġornat)         |
|            | Azzjonijiet Korporattivi | Frug ta' Ishma Bonus/Frug ta' Ishma Bonus                           | Iva, jekk l-identifikatur sottostanti rrapportat (eż. ISIN jew LEI) jew termini ta' negozju oħra jinbidlu | Modifika        | Event Korporattiv | Jekk wieħed jassumi li l-azzjoni korporattiva sseħħ fl-istrument/emittent sottostanti |
|            |                          | Dividend Speċjali                                                   |                                                                                                           | Modifika        | Event Korporattiv |                                                                                       |
|            |                          | Spin-Off                                                            |                                                                                                           | Modifika        | Event Korporattiv |                                                                                       |
|            |                          | Frazzjonament tal-ishma/Tibdil fil-valur nominali                   |                                                                                                           | Modifika        | Event Korporattiv |                                                                                       |
|            |                          | Retrofrazzjonament tal-ishma/Tibdil fil-valur nominali              |                                                                                                           | Modifika        | Event Korporattiv |                                                                                       |
|            |                          | Azzjonijiet korporattivi oħra li jaffettwaw id-dettalji rrapportati |                                                                                                           | Modifika        | Event Korporattiv |                                                                                       |

**TABELLA 12**

| Kategorija | Avveniment tan-Negożju                                | Dettall                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | Rapport abbli?                                                                 | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Kumment |
|------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------------|---------|
|            | Konverżjonijiet                                       | Il-partijiet li jiftiehem u jagħtu l-kunsens tagħhom reċiprokament għal konverżjoni li tirriżulta f'emenda materjali. Eżempju huwa swap fuq ADR li jiġi konvertit għal swap fuq l-azzjoni sottostanti kif miftiehem miż-żewġ partijiet, jew azzjoni tiġi elenkata darbtejn u hija konvertita minn linja GBP għal linja HK kif miftiehem miż-żewġ partijiet. | Iva                                                                            | Modifika        | Negożju       |         |
|            | Indiċi tal-Is wap Innegożjat / Elenkat b'Mod Pubbliku | L-iswap jitneħħa/jinbidel fl-indiċi mill-amministratur tal-indiċi (jiġifieri mhux fid-diskrezzjoni tan-negożjant jew tal-kontroparti). Eżempju huwa r-roll trimestrali għas-CDS tal-indiċi. Ma jinkludix ir-                                                                                                                                                | Le, jekk l-identifikatur sottostanti jew termini ta' negożju oħra ma jinbidlux |                 |               |         |

**TABELLA 12**

| Kategorija         | Avveniment tan-Negozju                                                             | Dettall                                                                                                                                                                                                               | Rapport abbli? | Tip ta' azzjoni        | Tip ta' event         | Kumment                                                                        |
|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------|
|                    |                                                                                    | riekwilibriju tal-indiċi                                                                                                                                                                                              |                |                        |                       |                                                                                |
|                    | Skattar tar-rati ta' riżerva                                                       | Tibdil fir-rata varjabbla minħabba event ta' riżerva                                                                                                                                                                  | Iva            | Modifika               | Negozju               |                                                                                |
|                    | Swap tal-Indiċi tal-Basket Personalizzat                                           | Il-komponenti tal-basket jinbidlu fuq id-diskrezzjoni tan-negozjant jew tal-kontroparti. Eżempju huwa r-riekwilibriju tal-basket billi jingħalaq swap fuq biljett antik u jiġi prenotat dak l-iswap fuq biljett ġdid. | Iva            | Modifika               | Negozju               | L-istrumenti finanzjarji biss innegozjati f'centru tan-negozjar                |
| Swap tal-Portafoll | Żieda ta' Titolu Sottostanti ta' Referenza għal Portafoll Twil jew Portafoll Qasir | Il-ħolqien ta' kuntratt ta' swap ġdid fuq Titolu XYZ.                                                                                                                                                                 | Iva            | Ġdid                   | Negozju               | Jekk wieħed jassumi li l-komponenti tal-portafoll huma rrapportati bħala swaps |
|                    | Tneħħija ta' Titolu Sottostanti ta'                                                | Terminazzjoni parzjali jew sħiħa ta' kuntratt ta'                                                                                                                                                                     | Iva            | Terminazzjoni/Modifika | Terminazzjoni bikrija | individwali (potenzjalment parti minn                                          |

**TABELLA 12**

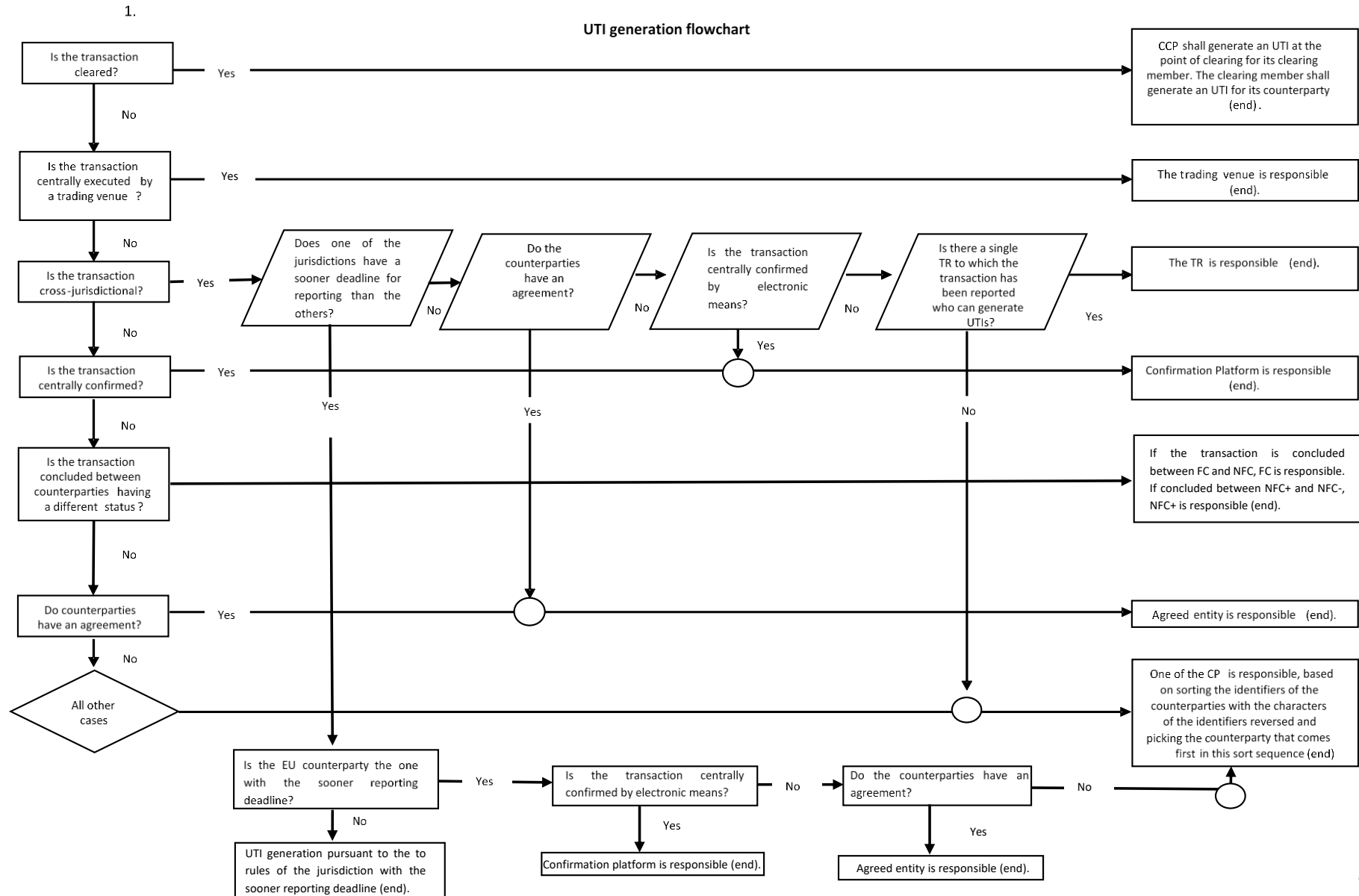
| Kategorija | Avveniment tan-Negozju                                                        | Dettall                                                                                    | Rapport abbli? | Tip ta' azzjoni | Tip ta' event | Kumment           |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|---------------|-------------------|
|            | Referenza għal Portafoll Twil jew Portafoll Qasir                             | swap eżistenti fuq Titolu XYZ.                                                             |                |                 |               | negozju kumpless) |
|            | Żieda fl-Ammont Nozzjonali għat- Titolu Sottostanti ta' Referenza Eżistenti   | Żieda tal-iskopertura twila jew qasira għat- Titolu XYZ.                                   | Iva            | Modifika        | Negozju       |                   |
|            | Tnaqqis fl-Ammont Nozzjonali għat- Titolu Sottostanti ta' Referenza Eżistenti | Tnaqqis fl-iskopertura twila jew qasira għat- Titolu XYZ f'wrapper ta' swap tal-portafoll. | Iva            | Modifika        | Negozju       |                   |

### 3.11 Ġenerazzjoni tal-UTI

192. Il-ġenerazzjoni u l-komunikazzjoni f'waqtha tal-UTI hija essenzjali biex jiġi żgurat li l-kontropartijiet ikunu jistgħu jikkonformaw b'mod puntwali mal-obbligu ta' rapportar tagħhom. Meta waħda mill-kontropartijiet tkun responsabbli mill-ġenerazzjoni tal-UTI, iż-żewġ kontropartijiet għandhom jagħmlu l-arranġamenti neċessarji sabiex il-kontroparti ġeneratriċi, tiġġenera l-UTI b'mod puntwali, tużah fir-rapportar tagħha stess u tikkomunikah lill-kontroparti l-oħra, u l-kontroparti li tirċevi, tinkorpora l-UTI u tuża l-istess UTI (mingħajr alterazzjoni jew tqassir) fir-rapportar tagħha stess. Bħala l-aqwa Prattika, l-intervent manwali fil-proċess ta' kondiviżjoni tal-UTI għandu jiġi evitat u l-mezzi diġitali għandhom jiġu preferuti.
193. Id-data tal-għeluq tal-10:00 am għall-ġenerazzjoni u għall-komunikazzjoni tal-UTI tapplika għad-derivattivi kollha, inklużi d-derivattivi rrapportati fil-livell tal-pożizzjoni. Fil-każ li l-parti ġeneratriċi ma jirnexxilhiex tiġġenera jew tikkomunika l-UTI fil-ħin xieraq, li huwa 10:00 am UTC sa T+1, sabiex tilhaq id-data tal-għeluq

tar-rapportar, il-parti li tirċievi għandha tikkuntattja l-parti generatriċi u ssaqsi dwar il-proċess minflok tirrapporta bl-użu ta' UTI ġġenerat waħdu.

194. Il-flowchart ta' hawn taħt turi kif il-kontropartijiet għandhom jiddeterminaw l-entità responsabbli mill-ġenerazzjoni tal-UTI f'konformità mal-Artikolu 7 tal-ITS dwar ir-rapportar.



195. Jekk l-entità responsabbli mill-generazzjoni tal-UTI (eż. centru f'pajjiż terz jew pjattaforma tal-konferma) ma tkunx soġġetta għall-EMIR u ma tkunx kapaċi/lesta li tiġġenera l-UTI, il-partijiet għandhom isegwu l-pass li jmiss fil-kaskata tal-generazzjoni tal-UTI. Jekk l-aħħar pass tal-kaskata jagħti r-responsabbiltà lill-kontroparti l-oħra li mhijiex kontroparti tal-UE u dik il-kontroparti ma tipprovdi l-UTI, il-kontroparti li tirrapporta għandha tiġġenera UTI waħedha sabiex tilhaq id-data tal-għeluq tar-rapportar. Madankollu, jekk il-kontroparti mhux tal-UE tipprovdi l-UTI tard u l-kontroparti tal-UE tkun diġà rrapportat bil-UTI tagħha stess, il-kontroparti tal-UE għandha timmarka “Żball” fuq id-derivattiv irrapportat u tirrapporta mill-ġdid bil-UTI generat f'konformità mal-ITS dwar ir-rapportar.
196. Meta l-proċess iwassal għall-pass tal-“ftehim tal-kontroparti”, il-kontropartijiet jistgħu jiddeċiedu eż. li dejjem waħda minnhom se tkun qed tiġġenera l-UTI jew jistgħu jiddeċiedu li japplikaw regolari oħra miftiehma komunement, inkluż loġika determinanti tal-għażla tagħhom. Il-loġika magħżula għandha tkun sempliċi biżżejjed biex tiżgura determinazzjoni ċara tal-kontroparti responsabbli mill-generazzjoni tal-UTI f'kull każ.
197. Is-soluzzjoni tal-aħħar istanza tiddetermina l-entità li tiġġenera l-UTI billi torganizza l-identifikaturi LEI f'ordni maqluba. Għal dan l-iskop, il-kontropartijiet għandhom jużaw il-metodu ta' organizzazzjoni ASCII, fejn numru dejjem jiġi qabel ittra:

| TABELLA 13                                                                             |                                                                 |                                                              |
|----------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
|                                                                                        | Eżempju 1                                                       | Eżempju 2                                                    |
| LEI                                                                                    | CP1:<br>1111ABCDEABCDEABC123<br>CP2:<br>1111AAAAABBBBBCCCC23    | CP1:<br>ABCDEABCDEABCDE12345<br>CP2:<br>ABCDEABCDEAAAAA12344 |
| LEI fl-ordni maqluba                                                                   | 321CBAEDCBAEDCBA1111<br>32CCCB BBBBAAAAA1111                    | 54321EDCBAEDCBAEDCBA<br>44321AAAAAEDCBAEDCBA                 |
| Organizzat abbażi ta' karattru b'karattru, numru jiġi dejjem qabel ittra (ordni ASCII) | 321CBAEDCBAEDCBA1111<br>għax “1” (numru) jiġi qabel “C” (ittra) | 44321AAAAAEDCBAEDCBA<br>għax “4” jiġi qabel “5”              |

198. Il-generazzjoni attwali tal-UTI tista' tiġi ddelegata, li jfisser li kwalunkwe entità determinata bħala l-entità responsabbli mill-generazzjoni tal-UTI f'konformità mal-ITS dwar ir-rapportar, tista' tiddelega l-generazzjoni tal-UTI lil parti terza.

Madankollu, għandha tiżgura li l-parti terza tikkonforma mar-rekwiżiti kollha rilevanti fir-rigward tal-puntwalità tal-generazzjoni tal-UTI, l-istruttura u l-format tal-UTI eċċ.

### 3.12 Determinazzjoni tan-naħa tal-kontroparti

199. L-Artikolu 4 tal-ITS dwar ir-rapportar jipprevedi li n-naħa tal-kontroparti tal-kuntratt tad-derivattiv għandha tiġi determinata fil-ħin tal-konklużjoni tad-derivattiv abbażi tat-tip ta' kuntratt konkluż.
200. Abbażi ta' dan t'hawn fuq, il-kontropartijiet għandhom jiddeterminaw in-naħa tal-kontroparti fil-ħin tal-konklużjoni tad-derivattiv u jirrapportaw jew Xerrej/Bejjiegħ fil-kamp "Direzzjoni" jew "Pagatur/Riċevitur" fil-kampijiet "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" skont it-tip tad-derivattiv konkluż, kif ipprovdut fit-tabella ta' hawn taħt.
201. Il-kontropartijiet, malli tiġi determinata n-naħa tal-kontroparti, għandhom jirrapportaw il-kampijiet relatati ma' "Direzzjoni", "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" mal-valuri opposti.
202. Dan ifisser li fil-każ li żewġ kontropartijiet ikunu kkonkludew kuntratt li jeħtieġ il-mili tal-kamp "Direzzjoni", jekk il-kontroparti 1 tirrapporta Xerrej fil-kamp "Direzzjoni", il-kontroparti l-oħra fil-kuntratt għandha tirrapporta "Bejjiegħ" u viċi versa.
203. B'mod simili, jekk wieħed jassumi li l-kontropartijiet għandhom jaqblu dwar il-mod konsistenti ta' rapportar tal-komponenti rispettivi tad-derivattiv, fil-każ li żewġ kontropartijiet ikkonkludew kuntratt li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2", jekk il-kontroparti 1 tirrapporta Pagatur/Riċevitur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 1" u Riċevitur/Pagatur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 2", il-kontroparti l-oħra fil-kuntratt għandha tirrapporta Riċevitur/Pagatur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 1" u Pagatur/Riċevitur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 2". Jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 6.2.4 għal diskussjoni iktar dettaljata dwar ir-rapportar u r-rikonċiljazzjoni tad-derivattivi b'żewġ komponenti.
204. Huwa wkoll mistenni li l-kontroparti li tirrapporta Pagatur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 1" għandha tirrapporta Riċevitur fil-kamp "Direzzjoni tal-Komponent 2" u viċi versa.

**TABELLA 14 Użu tal-kampijiet ta' direzzjoni għal kull tip ta' prodott**

| Tip ta' kuntratt | Direzzjoni      | Direzzjoni tal-komponent 1 | Direzzjoni tal-komponent 2 |
|------------------|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| Opzjoni          | Xerrej/Bejjiegħ | -                          | -                          |

**TABELLA 14 Użu tal-kampijiet ta' direzzjoni għal kull tip ta' prodott**

| Tip ta' kuntratt                                                                             | Direzzjoni      | Direzzjoni tal-komponent 1 | Direzzjoni tal-komponent 2 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------------------------|----------------------------|
| Swapzjoni                                                                                    | Xerrej/Bejjiegħ | -                          | -                          |
| Munita Forward                                                                               | -               | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Swaps tal-Valuti                                                                             | -               | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Forward                                                                                      | Xerrej/Bejjiegħ |                            |                            |
| Forward mhux konsenjabbli (NDF)                                                              | -               | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Kuntratti tal-futuri                                                                         | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |
| CFD                                                                                          | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |
| Spreadbet                                                                                    | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |
| Swaps tad-Dividendi                                                                          | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |
| Swaps tat-Titoli                                                                             |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Swap tar-Rata tal-Imgħax                                                                     |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Swap tal-indiċijiet tal-inflazzjoni                                                          |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Swap bejn il-muniti                                                                          |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Strument għat-trasferiment tar-riskju ta' kreditu (minbarra l-opzjonijiet u s-swapzjonijiet) | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |
| Swap tal-Komoditajiet                                                                        |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Ftehim tar-Rata Forward                                                                      |                 | Pagatur/Riċevitur          | Riċevitur/Pagatur          |
| Derivattivi relatati mal-varjanza, mal-volatilità u mal-korrelazzjoni                        | Xerrej/bejjiegħ |                            |                            |

205. B'rabta mat-tipi ta' azzjoni "Valwazzjoni" u "Aġġornament tal-margni", il-kampijiet "Direzzjoni", "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" m'għandhomx jiġu rrapportati.

206. Meta pożizzjoni tkun ir-riżultat tal-innettjar tal-pożizzjoni għal 0, il-kamp "Direzzjoni" jista' jkun rapportat bħala Xerrej/Bejjiegħ, Bejjiegħ/Xerrej u l-kampijiet "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" jistgħu jiġu rrapportati bħala Pagatur/Riċevitur, Riċevitur/Pagatur peress li għall-iskop ta' rikonċiljazzjoni, dawn il-kampijiet m'għandhomx jiġu rikonċiljati f'dan il-każ. Jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 6.2.4 għal iktar dettalji dwar ir-rapportar u r-rikonċiljazzjoni tal-

kampijiet “Direzzjoni”, “Direzzjoni tal-komponent 1” u “Direzzjoni tal-komponent 2” meta l-pożizzjonijiet jiġu nnettjati għal zero.

### 3.13 Identifikazzjoni tal-kontropartijiet

207. L-Artikolu 3 tal-ITS dwar ir-rapportar jipprevedi li l-kontroparti 1 f’derivattiva u l-entità responsabbli mir-rapportar għandhom jiżguraw li, għall-iskop li jiġu rrapportati l-konklużjoni jew il-modifika ta’ derivattiv, id-*data* ta’ referenza relatata mal-kodiċi LEI tiegħu ISO 17442 tiġġedded f’konformità mat-termini ta’ kwalunkwe mill-Unitajiet Operattivi Lokali tas-Sistema LEI Globali.
208. Barra minn hekk, skont l-Artikolu 3 tal-ITS dwar ir-rapportar, il-kodiċi tal-Identifikatur ta’ Entità Ġuridika (LEI) tal-ISO 17442 għandu jintuża biex jidentifika entità ta’ senserija, CCP, membru tal-ikklerjar, kontroparti li hi entità ġuridika, entità li tippreżenta rapport, entità responsabbli mir-rapportar, u fornitur tas-servizz ta’ tnaqqis tar-riskju ta’ wara n-negozjar.
209. L-Artikolu 9(5) tal-EMIR jipprevedi li mill-inqas l-identitajiet tal-partijiet fil-kuntratti tad-derivattivi għandhom jiġu rrapportati. Dan ir-rekwiżit ma jistax jitneħħa. Għalhekk, kontroparti li qed taħdem ma’ kontropartijiet li ma jistgħux jiġu identifikati minħabba impedimenti legali, regolatorji jew kuntrattwali, ma titqiesx konformi mal-Artikolu 9(5) tal-EMIR.
210. Għandu jiġi nnotat li l-kontropartijiet li qed jirrapportaw skont l-EMIR għandhom dejjem jidentifikaw lilhom infushom mal-LEI tal-kwartieri ġenerali, peress li r-responsabbiltà legali mir-rapportar dejjem taqa’ fuq l-entità ġuridika u mhux fuq il-fergħa.
211. Sabiex jitnaqqsu l-problemi bir-rapportar dovuti għal LEI skaduti, il-kodiċi LEI tal-kontroparti 1 u tal-entità responsabbli mir-rapportar għandu, għall-iskop li jiġi rrapportat kwalunkwe derivattiv ġdid jew kwalunkwe modifika, jiġi mġedded u miżmum kif xieraq skont it-termini ta’ kwalunkwe mil-LOUs (Unitajiet Operattivi Lokali) tas-Sistema LEI Globali.
212. L-entitajiet apparti l-kontroparti 1 u l-entità responsabbli mir-rapportar jistgħu jiġu rrapportati b’LEI skadut f’konformità mar-regoli ta’ validazzjoni.
213. Meta jimtlew, l-LEI tal-kontroparti 2, l-RSE, tal-entità ta’ senserija, tas-CCP, tal-Membru tal-Ikklerjar, u tal-fornitur tas-servizz PTRR għandu jiġi inkluż fil-bażi ta’ *data* GLEIF miżmuma mill-Unità Operattiva Ċentrali, jiġifieri għandu jkun LEI validu.
214. Il-punt ta’ żmien rilevanti għall-validazzjoni tal-istatus tal-LEI huwa d-*data* tar-rapportar, kif speċifikat fir-regoli tal-validazzjoni.
215. Il-kamp “Pajjiż tal-kontroparti 2” għandu jimtela biss meta l-kamp “It-tip ta’ identifikatur tal-kontroparti 2” huwa “Falz”, jiġifieri, jirreferi għall-persuni naturali li mhux jaġixxu f’kapaċità kummerċjali u għandu jirreferi għall-kodiċi tal-pajjiż ta’ residenza ta’ dik il-persuna.

216. Il-kampijiet “Settur korporattiv tal-kontroparti 1” u “Settur korporattiv tal-kontroparti 2” għandhom jimtew bis-settur tal-kontroparti nnifisha u m’għandhomx jirreferu għas-settur tal-fergħa tagħha.
217. Fil-każ li l-kontroparti 2 tal-kuntratt tad-derivattiv tkun persuna naturali li mhix taġixxi f’kapaċità kummerċjali, għandu jintuża kodiċi tal-klijent. Il-kodiċijiet tal-klijenti għandhom jiġu rrapportati biss meta l-kamp “It-tip ta’ identifikatur tal-kontroparti 2” jimtela b’“Falz”.
218. Jekk il-kontroparti 2 tkun soġġetta għall-obbligu ta’ rapportar skont l-EMIR, il-kamp “Obbligu ta’ rapportar tal-kontroparti 2” għandu jimtela b’“Veru” peress li l-indikatur tal-obbligu ta’ rapportar huwa indipendenti mill-allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar u minn kwalunkwe arrangament ta’ delega.
219. Għandu jiġi nnotat li l-kamp “Obbligu ta’ rapportar tal-kontroparti 2” għandu jimtela b’“Falz” meta l-kontroparti 2 tal-kuntratt tad-derivattiv tkun persuna naturali li mhix taġixxi f’kapaċità kummerċjali, kontroparti mhux tal-UE, CCP mhux tal-UE, entità msemmija fl-Artikolu 1(4) tal-EMIR (BHI, Banek Ċentrali, eċċ).

| TABELLA 15                                                                         |                                         |
|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|
| Kontroparti 2                                                                      | Obbligu ta’ rapportar tal-kontroparti 2 |
| FC/NFC/CCP tal-UE                                                                  | VERU                                    |
| FC/NFC/CCP mhux tal-UE                                                             | FALZ                                    |
| PERSUNA NATURALI LI MHIX TAĠIXXI F’KAPAĊITÀ KUMMERĊJALI                            | FALZ                                    |
| ENTITAJIET FL-ART. 1(4) TAL-EMIR (BHI, BANEK ĊENTRALI, eċċ)                        | FALZ                                    |
| ENTITAJIET FL-ART. 1(5) TAL-EMIR (BANEK MULTILATERALI TAL-IŻVILUPP, MES, FSE, eċċ) | VERU                                    |

220. Il-kodiċijiet tal-klijent għandhom jiġu rrapportati bħala “LEI tal-Kontroparti 1 + Identifikatur Intern tal-Individwi”, fejn tali identifikatur intern għandu jkun uniku fil-livell tal-kontroparti li tirrapporta partikolari (kontroparti 1), jiġifieri l-klijent mhuwiex mistenni jkollu identifikatur intern uniku wieħed fost l-entitajiet kollha li jinnegożja magħhom. Barra minn hekk, l-identifikatur intern adottat għall-identifikazzjonijiet tal-individwi m’għandux jinkludi informazzjoni magħrufa bħala *data* personali (irrispettivament mis-sensittività tagħha).
221. Il-komponent LEI tal-kodiċi tal-klijent m’għandux jiġi aġġornat meta l-kontroparti li tirrapporta (li għaliha jappartjeni l-LEI) tgħaddi mill-event korporattiv.
222. Barra minn hekk, fil-każ tal-eventi korporattivi, fejn il-kontropartijiet affettwati jkollhom l-istess individwu bħala klijent u l-identifikatur intern assoċjat ma’ dak l-

individwu jkunu differenti bejn il-partijiet involuti, wara l-fużjoni l-kontroparti li tirrapporta għandha tidentifika dak l-individwu b'wieħed mill-identifikaturi interni użati qabel sabiex tiġi żgurata t-traċċabbiltà. B'mod partikolari għad-derivattivi konklużi reċentement, wieħed biss mill-kodiċijiet tal-klijent għandu jintuża b'mod konsistenti, dak li jibda bl-LEI tal-kontroparti li tirrapporta wara l-fużjoni. L-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja li jistgħu jiġu rrapportati għad-derivattivi pendenti fil-ħin tal-fużjoni għandhom jiġu rrapportati bil-kodiċijiet tal-klijent li ntużaw qabel l-event korporattiv għal dawk id-derivattivi.

**TABELLA 16 IR-RAPPORTAR TAL-KODIĊIJET TAL-KLIJENT FIL-KAŻ TA' EVENT KORPORATTIV**

| Qabel il-fużjoni | Kronogramma tar-rapportar | Kontroparti li Tirrapporta | Kontroparti oħra | ID tan-negozju | Tip ta' azzjoni |
|------------------|---------------------------|----------------------------|------------------|----------------|-----------------|
|                  | N                         | LEIAAAA                    | LEIAAAA123       | xyz            | Modifika        |
|                  | N                         | LEIBBBB                    | LEIBBBB456       | qwe            | Modifika        |

LEIBBBB tingħaqad ma' LEIAAAA sa T+1

| Wara l-fużjoni | Kronogramma tar-rapportar | Kontroparti li Tirrapporta | Kontroparti oħra | ID tan-negozju | Tip ta' azzjoni |
|----------------|---------------------------|----------------------------|------------------|----------------|-----------------|
|                | T+2                       | LEIAAAA                    | LEIAAAA123       | xyz            | Modifika        |
|                | T+2                       | LEIAAAA                    | LEIBBBB456       | qwe            | Modifika        |
|                | T+2                       | LEIAAAA                    | LEIAAAA123       | jkl            | Ġdid            |

### 3.14 Proċedura meta kontroparti tgħaddi minn azzjoni korporattiva

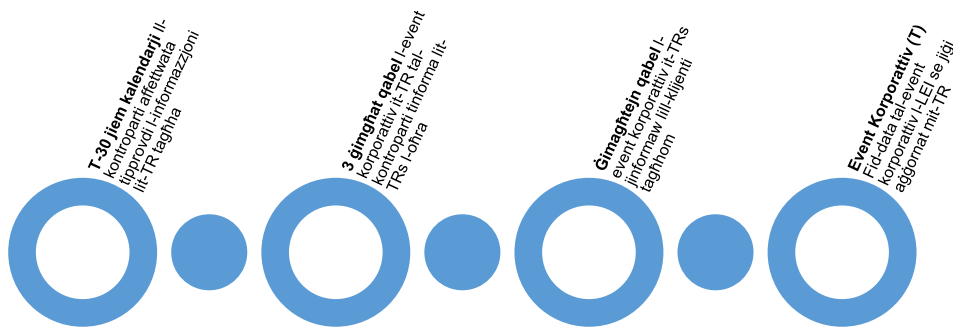
223. L-Artikolu 8 tal-ITS dwar ir-rapportar jistipula li meta kontroparti tgħaddi minn azzjoni korporattiva li tirriżulta fil-bidla tal-LEI tagħha, dik il-kontroparti jew l-ERR jew l-entità li ngħatat id-delega tar-rapportar għandha tinnotifika lit-TR rilevanti bil-bidla u titlob aġġornament tal-LEI. Barra minn hekk, l-Artikolu 2 tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* jipprevedi li t-TR li lilu hija indirizzata t-talba għandu jidentifika d-derivattivi pendenti fil-ħin tal-avveniment ta' ristrutturar korporattiv meta l-entità tiġi rrapportata bl-identifikatur antik fil-kamp "Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)" jew fil-kamp "Kontroparti 2" kif informat fit-talba rilevanti u għandu jissostitwixxi l-identifikatur antik bl-LEI l-ġdid fir-rapporti relatati ma' dawk id-derivattivi kollha dwar dik il-kontroparti fil-ħin tal-event korporattiv.

224. L-Artikolu 2 tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* jipprevedi wkoll il-proċedura u l-iskeda ta' żmien li għandhom jiġu segwiti mir-repożitorji tad-*data* dwar it-tranzazzjonijiet sabiex jiġi ffinalizzat kif xieraq l-aġġornament tal-LEIs għad-derivattivi kollha li jirrigwardaw il-kontroparti li tippreżenta t-talba skont l-Artikolu 8 tal-ITS dwar ir-rapportar.

225. L-aġġornament tal-LEI għandu jseħh fid-*data* tal-event ta' ristrutturar korporattiv. Jekk it-talba biex jiġi aġġornat l-LEI minħabba event korporattiv tasal għand it-TR iktar tard minn 30 ġurnata qabel l-event korporattiv, it-TR għandu jwettaq l-

aġġornament kemm jista' jkun malajr u mhux iktar tard minn 30 jum kalendarju mill-wasla tat-talba.

226. Sabiex tiġi żgurata l-komunikazzjoni f'waqtha bejn l-entità involuta fl-aġġornament u t-TR tagħha, il-kontroparti affettwata bil-bidla għandha tipprovdi l-informazzjoni meħtieġa kollha dwar il-fużjoni lit-TR tagħha mhux iktar tard minn 30 jum kalendarju qabel id-data tal-event korporattiv.
227. Fil-każ li l-kontroparti affettwara tkun entità minn pajjiż terz, il-kontroparti tal-UE jew l-entità responsabbli mir-rapportar jew l-entità li ngħatat id-delega tar-rapportar mill-kontroparti li tirrapporta tal-UE għandha tkun responsabbli biex tikkomunika l-bidla lit-TR.
228. Barra minn hekk, meta kontroparti ma tkunx responsabbli u legalment responsabbli mir-rapportar, l-entità responsabbli mir-rapportar hija responsabbli biex tikkomunika l-bidla lit-TR. Fil-każ ta' delega, ir-responsabbiltà għall-komunikazzjoni tal-bidla lit-TR għandha tkun tal-entità li tippreżenta rapport.
229. Għandu jiġi nnotat li meta l-kontroparti affettwata ma jkollha l-ebda relazzjoni kuntrattwali mat-TR, għandha tinforma lill-entità li tippreżenta rapport jew lill-entità responsabbli mir-rapportar. Xorta waħda, ir-responsabbiltà li jiġi informat it-TR tista' tiġi speċifikata mill-partijiet rilevanti f'att ta' delega.
230. Barra minn hekk, sabiex jiġi żgurat proċess ta' komunikazzjoni xieraq bejn it-TRs, it-TR li lillu ġiet indirizzata talba għall-aġġornament ta' LEI għandu jinforma lit-TRs l-oħra dwar it-twettiq ta' aġġornament ġdid ta' LEI mhux iktar tard minn 3 ġimgħat qabel id-data tal-event korporattiv.
231. Sabiex jiġi żgurat proċess ta' komunikazzjoni f'waqtu bejn it-TRs u l-klijenti tagħhom, it-TRs għandhom jinformaw lill-klijenti tagħhom dwar it-twettiq ta' aġġornament ġdid ta' LEI mhux iktar tard minn ġimagħtejn qabel id-data tal-event korporattiv.
232. Meta t-TR ikun qed ixandar informazzjoni dwar event korporattiv lill-klijenti tiegħu, kontroparti li tirrapporta li ma jkollha l-ebda relazzjoni kuntrattwali mat-TR għandha tiġi informata dwar tali event mingħajr dewmin bla bżonn mill-entità responsabbli mir-rapportar jew mill-entità li tippreżenta rapport, kif applikabbli.
233. L-entitajiet involuti fl-aġġornament huma mistennija jipprovdu l-informazzjoni kollha meħtieġa lil-LOUs tagħhom sabiex jiżguraw aġġornament xieraq u f'waqtu tal-LEI fil-bażi tad-data tal-GLEIF.



234. Jekk it-talba tasal iktar tard minn tletin jum kalendarju qabel l-event korporattiv, it-TR għandu jaġġorna l-LEI tad-derivattivi kollha li kienu pendenti fil-ħin li seħħ l-event korporattiv u bejn id-data tal-event korporattiv u d-data li t-TR iwettaq l-aġġornament. Għalhekk, id-derivattivi terminati/skaduti bejn iż-żewġ dati għandhom jiġi agġornati.
235. Jekk l-entitajiet affettwati jiġu rrapportati fil-kampijiet minbarra “Kontroparti 1 (kontroparti li tirrapporta”, “Kontroparti 2” jew “Entità responsabbli mir-rapportar” tad-derivattivi (per eżempju l-entità affettwata mill-bidla hija l-entità rrapportata fil-kampijiet “ID tas-sensar” jew “Membru tal-ikklerjar”), dawn l-entitajiet għandhom jipprovdu lit-TRs il-lista tal-UTIs affettwati mill-bidla jew, fil-każ li m’għandhomx din l-informazzjoni, id-dettalji kollha meħtieġa sabiex it-TRs ikunu jistgħu jidentifikaw id-derivattivi affettwati. F’dan il-każ, it-TRs għandhom iwettqu tali aġġornament biss wara konferma tar-rekords affettwati mill-kontroparti 1 jew mill-entità responsabbli mir-rapportar, kif applikabbli. Fejn il-kontroparti 1 jew l-entità responsabbli mir-rapportar ma twegħibx f’hin xieraq għat-twettiq tal-aġġornament, l-aġġornament tad-dettalji rilevanti ta’ dawn id-derivattivi jista’ jseħħ billi r-rapporti rilevanti jiġu ppreżentati bit-tip ta’ azzjoni “MODI”.
236. Fil-każ li l-event korporattiv jaffettwa biss subsett ta’ derivattivi (eż. Spin-offs), it-TRs għandhom jistabbilixxu proċeduri komuni għall-aġġornament tad-data tal-LEI fuq dawk il-kuntratti tad-derivattivi li jistgħu jiġi affettwati minn tibdil parzjali fl-LEIs. Ir-responsabbiltà li jiġi indikat liema UTIs huma affettwati mill-bidla għandha tibqa’ fuq il-kontropartijiet jew l-entitajiet responsabbli mir-rapportar. Iż-żewġ kontropartijiet/ERRs huma mistennija jikkomunikaw il-bidla lit-TRs tagħhom.
237. Negozji bl-LEI l-antik bi żball fuq jew terminat bi żball li huma attwalment pendenti fil-ħin tal-event korporattiv għandhom neċessarjament “jinfetħu mill-ġdid” qabel (jew fil-ħin) l-event korporattiv. Fil-każ li l-kontroparti jew l-ERR, kif applikabbli, tirrealizza wara l-event korporattiv li derivattivi bl-LEI antik terminat/bi żball fuq bi żball ma nfetħu mill-ġdid qabel (jew fil-ħin) tal-event korporattiv, il-kontroparti għandha tirrapporta dak id-derivattiv b’UTI ġdid. Min-naħa tagħha, il-kontroparti l-oħra għandha ttermina d-derivattivi tagħha u tirrapportah mill-ġdid bil-UTI ġġenerat reċentement. Dan ix-xenarju tal-aħħar għandu jseħħ biss bħala l-opzjoni tal-aħħar mizura filwaqt li jitqies li l-kontropartijiet affettwati minn event

korporattiv għandhom jivvalutaw bir-reqqa l-perimetru tad-derivattivi pendenti qabel ma jseħh l-event korporattiv.

238. It-TRs għandhom jipproduċu kwalunkwe informazzjoni dwar l-aġġornament tal-LEI, kif speċifikat fil-paragrafu 3(b) tal-Artikolu 2 tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, f'format li jinqara mill-magni sabiex jiffavorixxu proċess fil-ħin u awtomatiku tal-aġġornament tal-LEI mill-partijiet ikkonċernati (TRs, kontropartijiet li jirrapportaw, entitajiet li jippreżentaw rapport, entitajiet responsabbli mir-rapportar).

239. Il-proċedura pprovduta fl-Artikolu 2 tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* u l-iskedi taż-żmien ipprovduti hawn fuq għandhom jiġu segwiti anki b'referenza għax-xenarju tal-aġġornament mill-BIC jew identifikaturi oħra ta' LEI.

### 3.15 Identifikazzjoni u klassifikazzjoni tal-prodotti

#### Kjarifiki ġenerali

240. Kif speċifikat fl-ITS dwar ir-rapportar, id-derivattivi li huma (i) ammessi għan-negozju jew innegozjati f'ċentru tan-negozjar jew (ii) huma nnegozjati f'internalizzatur sistematiku u s-sottostanti tagħhom huwa ammess għan-negozju jew innegozjat f'ċentru tan-negozjar jew huwa indiċi jew basket magħmul mill-istrumenti nnegozjati f'ċentru tan-negozjar; għandhom jiġu identifikati fil-kamp 2.7 bl-użu ta' kodiċi tan-Numru Internazzjonali għall-Identifikazzjoni tat-Titoli (ISIN) tal-ISO 6166. Id-derivattivi li jifdal għandhom jiġu identifikati fil-kamp 2.8 bl-użu ta' kodiċi tal-Identifikatur Uniku tal-Prodott (UPI) tal-ISO 4914. Fil-każ speċifiku tad-derivattivi nnegozjati fuq skambju f'pajjiż terz, l-identifikazzjoni tal-prodott mhijiex meħtieġa jekk kemm l-ISIN kif ukoll il-UPI ma jkunux disponibbli. B'dan il-mod, il-prodotti derivattivi rilevanti jistgħu jkunu identifikati b'mod uniku, filwaqt li l-kontropartijiet huma meħtieġa jipprovdu biss mod wieħed ta' identifikazzjoni għal prodott partikolari u l-konsistenza mar-rekwiżiti ta' rapportar tal-MiFIR tinżamm.

241. Barra minn hekk, il-kontropartijiet għandhom jikklassifikaw id-derivattivi kollha bl-użu tal-kodiċi (kamp 2.9) tal-Klassifikazzjoni tal-Istrumenti Finanzjarji (CFI) tal-ISO 10692. Il-kontropartijiet għandhom dejjem jużaw sorsi uffiċjali għas-CFI. Għal dan l-iskop, is-CFI mogħti mid-Derivatives Service Bureau ta' ANNA (DSB ANNA) jew mill-Aġenzija Nazzjonali Numerika (NNA) rilevanti għandu jintuża. Iktar informazzjoni tista' tinkiseb mid-DSB ANNA (<https://www.anna-dsb.com/ufaqs/cfi-code/>), minn ANNA (<http://www.annaweb.org/standards/about-identification-standards/>), jew mill-NNA rilevanti tad-derivattiv.

242. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw CFIs validi biss. Fil-każ tad-derivattivi identifikati b'UPI, is-CFI huwa mistenni li jkun dejjem disponibbli. Għad-derivattivi l-oħra, jekk is-CFI ma jeżistix fis-sorsi uffiċjali, il-kontropartijiet għandhom jitolbuh lill-NNA rilevanti.

#### Identifikazzjoni tal-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju

243. Jekk il-kontropartijiet jidhlu fi swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju (irrispettivament minn kif il-prodott ġie sussegwentement ikkonfermat jew saldat),

huma għandhom jirrapportawh f'rapport uniku u jidentifikaw il-prodott bil-UIP jew bl-ISIN li jappartjeni għal dak l-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju. Għandu jiġi nnotat li l-gwida teknika tal-UIP tara b'mod esplicitu l-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju bħala prodott separat, għalhekk m'hemm l-ebda raġuni għalfejn l-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju għandu jinqasam f'kuntratt forward tal-kambju għall-iskop tar-rapportar.

#### Id-data ta' referenza tal-UIP

244. L-ESMA hija tal-fehma li l-biċċa l-kbira tal-kampijiet tad-*data* ta' referenza tal-UIP jew kollha kemm huma m'għandhux ikollhom jiġu rrapportati għall-prodotti identifikati b'UIP, ladarba s-sistema tal-UIP tkun stabbilita kompletament u ż-żewġ awtoritajiet u partiiċipanti fis-suq jiksbu iktar esperjenza bl-użu tal-UIP. Barra minn hekk, kunsiderazzjoni simili tapplika għall-prodotti identifikati b'ISIN li għalihom id-*data* ta' referenza hija disponibbli fis-Sistema ta' *Data* ta' Referenza tal-Istrumenti Finanzjarji (FIRDS). Filwaqt li l-elementi tad-*data* li jistgħu jiġu rrapportati kollha se jkunu meħtieġa fil-bidu tar-rapportar, l-ESMA diġà qed tqis liema elementi tad-*data* jistgħu jingabru mil-librerija tad-*data* ta' referenza tal-UIP jew mill-FIRDS minflok jiġu rrapportati lit-TRs.
245. Malli r-regoli ta' validazzjoni jiġu emendati fi stadju iktar tard biex jagħmlu t-tali kampijiet kollha jew uħud minnhom obbligatorji b'mod kundizzjonali, il-kontropartijiet għandhom isegwu r-regoli ta' validazzjoni u ma jirrapportawx dawn il-kampijiet għad-derivattivi identifikati b'UIP/ISIN.

### **3.16 Identifikazzjoni tas-sottostanti**

246. Is-sottostanti għandu jiġi identifikat bl-użu ta' identifikatur uniku għal dan is-sottostanti abbażi tat-tip tiegħu. Il-kampijiet 2.13-2.18 jiddeskrivu s-sottostanti, u l-kamp "Tip ta' identifikazzjoni tas-sottostanti" b'mod partikolari jindika li s-sottostanti huwa basket, indiċi jew assi identifikat b'ISIN.
247. Fil-każ tad-derivattivi fuq l-indiċi, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw l-ISIN tal-indiċi sottostanti, jekk disponibbli, iktar milli l-ISIN tad-derivattiv. Barra minn hekk, skont l-RTS dwar ir-rapportar, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-kodiċi standardizzati li jindika l-indiċi (jekk disponibbli) kif ukoll l-isem tal-indiċi li għandu dejjem jimtela.
248. Fil-każ tad-derivattivi ta' kreditu, il-kamp "Identifikazzjoni tas-sottostanti" għandu jiġi rrapportat fil-każ ta' Swap ta' Inadempjenza ta' Kreditu (CDS) abbażi ta' obbligu ta' referenza speċifiku. Għall-hedging tas-CDS kontra l-inadempjenza ta' entità, tali entità għandha tiġi rrapportata fil-kamp "Entità referenzjarja".

### 3.17 Kampijiet tal-prezz, tan-nozzjonali u tal-kwantità

#### Rapportar tal-prezz

249. Meta jiġu rrapportati l-kuntratti tad-derivattivi, f'konformità mal-Artikolu 6(2) tal-RTS dwar ir-rapportar, il-kontropartijiet għandhom jużaw il-kamp 2.48 "Prezz" biss meta l-informazzjoni dwar il-prezz ma tkunx inkluża f'kamp ieħor tar-rapport.
250. Skont l-Artikolu 6(1) tal-RTS dwar ir-rapportar, il-kontropartijiet għandhom jimlew il-kamp 2.48 meta jirrapportaw it-tipi ta' derivattivi li ġejjin:
- swaps b'pagamenti perjodiċi relatati mal-komoditajiet (prezz fiss li għandu jimtela fil-kamp 2.48);
  - kuntratti forward relatati mal-komoditajiet jew mal-ekwitajiet (prezz forward tas-sottostanti għandu jimtela fil-kamp 2.48);
  - swaps relatati mal-ekwitajiet, jew kuntratti għal differenza (prezz inizjali tas-sottostanti għandu jimtela fil-kamp 2.48).
251. Il-lista fl-Artikolu 6(1) tal-RTS dwar ir-rapportar mhijiex eżawrjenti. Meta jkun hemm derivattivi fejn il-prezz ma jkunx speċifikat f'kamp ieħor, il-kamp "Prezz" għandu jimtela. Eżempji ta' tali derivattivi jinkludu futuri relatati mal-komoditajiet jew mal-ekwitajiet, fejn il-prezz forward tas-sottostanti għandu jiġi rrapportat fil-kamp "Prezz".
252. Madankollu, il-kamp 2.48 mhuwiex applikabbli u m'għandux jimtela meta jkun qed jiġi rrapportat wieħed mit-tipi ta' derivattivi li ġejjin:
- Swaps tar-rata tal-imgħax u ftehimiet tar-rata forward, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet "Rata fissa tal-komponent 1"/"Rata fissa tal-komponent 2" u "Firxa tal-komponent 1"/"Firxa tal-komponent 2" għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
  - L-opzjonijiet tar-rata tal-imgħax u is-swapzjonijiet tar-rata tal-imgħax, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet "Prezz tal-eżerċitar" u "Ammont tal-primjum tal-opzjoni" għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
  - Swaps varjabbli tal-komoditajiet, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kamp "Firxa tal-komponent 1"/"Firxa tal-komponent 2"<sup>23</sup> għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
  - L-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju, il-kuntratti forward u l-opzjonijiet, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet "Rata tal-kambju 1" u "Rata tal-kambju forward", "Prezz tal-eżerċitar", u "Ammont tal-primjum tal-opzjoni" għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.

---

<sup>23</sup> Għalkemm il-kampijiet tal-Firxa huma fit-taqsima tar-Rata tal-Imgħax tat-tabella tal-kampijiet, għandhom jimtlew meta applikabbli (skont id-deskrizzjonijiet tal-kamp fl-RTS). L-istess approċċ għandu jiġi segwit fir-rapportar eż. ir-rata tal-firxa u fissa tas-CDS.

- e. L-opzjonijiet tal-ekwità, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet “Prezz tal-eżerċitar” u “Ammont tal-primjum tal-opzjoni” għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
  - f. Swaps ta’ inadempjenza ta’ kreditu, swaps tar-redditu totali tal-kreditu, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet “Rata fissa tal-komponent 1”/“Rata fissa tal-komponent 2” u “Firxa tal-komponent 1”/“Firxa tal-komponent 2” u “Ammont ta’ pagament ieħor” (meta l-kamp “Tip ta’ pagament ieħor” jimtela b’UFRO”) għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
  - g. L-opzjonijiet fuq komoditajiet, kif inhu mifhum li l-informazzjoni inkluża fil-kampijiet “Prezz tal-eżerċitar” u “Ammont tal-primjum tal-opzjoni” għandhom jiġu interpretati bħala l-prezz tad-derivattiv.
253. Jekk il-kuntratt tad-derivattiv għandu prezz li jvarja bi skeda matul il-ħajja tad-derivattiv (u l-informazzjoni dwar il-prezz mhijiex rapportata f’kamp tad-*data* ieħor), il-kampijiet 2.50-2.52 għandhom jimteww sabiex l-iskeda tal-prezz tiġi rapportata għaċ-ċiklu tal-ħajja kollu.
254. Eżempji tar-rapportar tal-prezz għal prodotti differenti (billi jiġi speċifikat fil-kamp dedikat jew permezz ta’ kampijiet tad-*data* oħrajn) jistgħu jinsabu fit-taqsimha 6.

#### Rapportar tan-nozzjonali u tal-kwantità

255. Il-kampijiet tal-ammont nozzjonali (kampijiet 2.55 u 2.64) għandhom jimteww f’konformità mal-Artikolu 5 tal-RTS dwar ir-rapportar. Il-kampijiet 2.57 sa 2.59 u 2.66 sa 2.68 huma ripetibbli u għandhom jimteww fil-każ tad-derivattivi li jinvolvu l-iskedi tal-ammont nozzjonali. L-iskeda tal-ammont nozzjonali, jekk applikabbli, għandha timtela wkoll f’konformità mal-Artikolu 5 tal-RTS dwar ir-rapportar.
256. Meta jirrapportaw l-iskeda tal-ammont nozzjonali, il-kontropartijiet għandhom jindikaw:
- a. id-*data* mhux aġġustata li fiha l-ammont nozzjonali assoċjat isir effettiv;
  - b. id-*data* tat-tmiem mhux aġġustata tal-ammont nozzjonali; u
  - c. l-ammont nozzjonali li jsir effettiv fid-*data* effettiva mhux aġġustata assoċjata.
257. Fil-każ tad-derivattivi li jinvolvu l-iskedi tal-ammont nozzjonali, id-“*data* tat-tmiem” mhijiex meħtieġa jekk id-*data* tat-tmiem tiġi eżatt mad-*data* effettiva tal-perjodu sussegwenti.
258. Fil-każ tad-derivattivi li jinvolvu l-iskedi tal-ammont nozzjonali, id-dhul tal-ammont nozzjonali fil-kamp 2.55 (“Ammont nozzjonali tal-komponent 1”), għandu jiddaħhal fil-kampijiet tal-iskeda tal-ammont nozzjonali. L-istess japplika għall-kamp “ammont nozzjonali tal-komponent 2”, jekk applikabbli.
259. Meta tiġi rapportata skeda tal-ammont nozzjonali, l-iskedi tad-*data* għandhom jiġu rapportati f’ordni kronoloġiku.
260. Kwalunkwe aġġornamenti fl-ammont nozzjonali li mhumieq marbuta ma’ skeda nozzjonali bil-quddiem miftiehma, għandhom jiġu rapportati bħala modifika.

261. Fil-każ meta pożizzjoni tiġi nnettjata (in-nozzjonali tal-pożizzjoni issir żero) hemm żewġ modi possibbli biex tipproċedi:
- a. Il-pożizzjoni tista' tiġi terminata. Jekk il-pożizzjoni tinfetaħ mill-ġdid, għandha tiġi rrapportata b'UTI ġdid.
  - b. Il-kontropartijiet jistgħu jżommu l-pożizzjoni miftuħa u jirrapportaw valur tal-kuntratt żero ta' kuljum. Jekk imbagħad negozji ġodda jiġu inkorporati f'din il-pożizzjoni, in-nozzjonali, u kampijiet rilevanti oħra, għandhom jiġu aġġornati kif xieraq.
262. Għe osservat li n-nozzjonali żero jiġi xi kultant irrapportat eż. fil-każ ta' f'ruġ ta' dritt volontarju mogħti lid-detentur ta' CFD jew fil-każ ta' CFDs li jirriżultaw minn azzjoni korporattiva fuq is-sottostanti (frazzjonament tal-ishma), u għalhekk ikollu prezz tax-xiri ta' żero. Dan mhuwiex meqjus bħala mod korrett ta' rapportar.
263. Fir-rigward tal-mili tan-Nozzjonali fil-livell tal-pożizzjoni, jekk jogħġbok irreferi għall-kjarifika pprovduta fit-taqsim 3.7.
264. Fir-rigward tal-ammont nozzjonali għad-derivattivi tal-indiċi ta' kreditu wara bidla fil-fattur tal-indiċi minhabba avvenimenti ta' kreditu, il-kontropartijiet m'għandhomx - sabiex jevitaw għadd doppju tal-aġġustament - jimmodifikaw in-nozzjonali iżda jaġġornaw biss il-kamp 2.147 "Fattur tal-indiċi".
265. Meta jiġu rrapportati derivattivi ta' komoditajiet mhux standard fejn in-nozzjonali mhuwiex magħruf meta jitwettaq il-kuntratt, għandu jittieħed l-approċċ li ġej: irrapporta stima tal-ammont nozzjonali, li tiġi perġodikament rieżaminata meta t-tranzazzjoni tkun qed tiġi kkunsinjata. Jekk in-nozzjonali jsir magħruf matul il-ħajja tal-kuntratt tad-derivattiv, għandha tiġi ppreżentata modifika li temenda l-ammont nozzjonali.
266. Biex nelaboraw iktar dwar il-paragrafu ta' hawn fuq, huwa importanti li l-kontropartijiet f'dawn id-derivattivi ta' komoditajiet mhux standard jaqblu dwar l-approċċ għall-kalkolu tan-nozzjonali sabiex in-nozzjonali rrapportat ikun konsistenti. Pereżempju, in-nozzjonali rrapportat huwa bbażat fuq previżjoni tal-produzzjoni. Il-kontropartijiet iridu wkoll jaqblu dwar meta għandhom jaġġornaw in-nozzjonali biex tiġi żgurata l-konsistenza fl-ammonti nozzjonali aġġornati.

#### Kampijiet tal-kwantità nozzjonali totali

267. Il-kwantità nozzjonali totali għandha tinftiehem bħala l-kwantità nozzjonali aggregata tal-ass sottostanti għat-terminu tad-derivattiv. Meta l-kwantità nozzjonali totali ma tkunx magħrufa meta derivattiv ġdid jiġi rrapportat u għalhekk tiġi rrapportata b'valur awtomatiku, il-kwantità nozzjonali totali għandha tiġi aġġornata meta ssir disponibbli.
268. Il-kwantità nozzjonali totali tapplika għall-ETDs b'mod iktar ġenerali. Dan il-kamp huwa rilevanti għall-ekwitajiet u għall-komoditajiet. Jekk applikabbli, għandu jimtela wkoll għall-klassijiet tal-assi l-oħra. Il-kampijiet 2.61 sa 2.63 u 2.70 sa 2.72 huma ripetibbli u għandhom jimtlew fil-każ tad-derivattivi li jinvolvu l-iskedi tal-ammont nozzjonali.

269. Fil-każ tad-derivattivi li jinvolve l-iskedi tal-kwantità nozzjonali, id-dhul tal-kwantità nozzjonali totali fil-kamp 2.60 ("Kwantità nozzjonali tal-komponent 1"), għandu jiddaħħal ukoll fil-kampijiet tal-iskeda tal-kwantità nozzjonali. L-istess japplika għall-kamp "Kwantità nozzjonali tal-komponent 2", jekk applikabbli.
270. Fil-każ tad-derivattivi li jinvolve l-iskedi tal-kwantità nozzjonali, id-"data tat-tmiem" mhijiex meħtieġa jekk id-data tat-tmiem tiġi eżatt mad-data effettiva tal-perjodu sussegwenti.
271. Meta tiġi rrapportata skeda tal-kwantità nozzjonali, l-iskedi tad-data għandhom jiġu rrapportati f'ordni kronoloġiku.

### 3.18 Rapportar tal-valwazzjonijiet

272. Jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 6.2.3 għal iktar gwida dwar ir-rikonċiljazzjoni tad-data tal-valwazzjonijiet.

#### Valwazzjoni tal-kuntratt

273. L-Artikolu 4 tal-RTS dwar ir-rapportar jipprevedi li l-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-valwazzjoni kif ġej:
- Għad-derivattivi kklerjati - il-valwazzjoni tad-derivattiv ipprovdut mis-CCP. Dan ma jfissirx li r-rapport għandu jsir mis-CCP. Is-CCP għandha tagħmel id-data disponibbli għall-kontropartijiet sabiex dawn tal-aħħar jirrapportaw. L-użu tad-data tal-valwazzjoni tas-CCP ma jfissirx id-duplikazzjoni tar-rapportar.
  - Għad-derivattivi mhux ikklerjati - il-valwazzjoni tad-derivattiv imwettaq f'konformità mal-metodoloġija ddefinita fl-Istandard Internazzjonali tar-Rappurtaġġ Finanzjarju 13 Kejl tal-Valur Ġust kif adottat mill-Unjoni u msemmi fl-Anness għar-Regolament tal-Kummissjoni (KE) Nru 1126/2008, mingħajr ma jiġi applikat l-ebda aġġustament għall-valur ġust. Dan ifisser li l-kontropartijiet m'għandhomx japplikaw għall-iskop tar-rapportar skont l-EMIR kwalunkwe aġġustamenti fil-valwazzjoni (bħas-CVA jew id-DVA), anki jekk tali aġġustamenti jiġu applikati għall-iskopijiet tal-kontabilità.
274. Meta l-kontropartijiet jiddelegaw ir-rapportar, inkluż il-valwazzjonijiet, huma jżommu r-responsabbiltà li jiżguraw li r-rapporti ppreżentati f'isimhom ikunu preċiżi. Fil-każ tal-allokazzjoni tar-responsabbiltà għar-rapportar skont l-Artikolu 9(1a)-9(1d) tal-EMIR, l-entità responsabbli mir-rapportar hija responsabbli mill-preċiżjoni tal-valwazzjoni ppreżentata f'isem il-kontroparti li tirrapporta.
275. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-valwazzjoni attwali tal-kuntratt (pożittiv jew negattiv), iktar milli valur assolut. Tipikament, il-valwazzjoni tal-kuntratt se tkun pożittiva għal kontroparti waħda u negattiva għall-oħra. Għandu jiġi nnotat li skont l-istandards tekniċi, il-valwazzjoni se tkun parti mid-data rikonċiljabbli, għalhekk il-kontropartijiet għandhom jibagħtu valwazzjoni konsistenti (jiġifieri l-valur assolut tal-valwazzjoni għandu jirrikonċilja, filwaqt li s-sinjali se jkunu opposti).

276. B'mod ġenerali, il-valur ipprezzat skont il-valur fis-suq għandu jirrappreżenta l-valur totali tal-kuntratt, iktar milli bidla ta' kuljum fil-valwazzjoni tal-kuntratt. Madankollu, meta skont il-mudell Settle-to-Market (STM) il-valwazzjoni tiġi risettjata għal żero kuljum u l-marġni ta' varjazzjoni tiġi saldata, il-kontropartijiet u s-CCPs għandhom jirrapportaw il-bidla ta' kuljum fil-valwazzjoni.
277. Għandu jiġi wkoll innotat li mhuwiex awtorizzat li tiġi rrapportata valwazzjoni żero tal-kuntratt esklussivament abbażi li m'hemm l-ebda riskju tas-suq għax marġni ta' varjazzjoni ġie skambjat. Kwalunkwe marġni m'hallas jew riċevut se jiġi rifless fil-kampijiet 3.12-3.27 u mhux fil-valwazzjoni.
278. Ir-rekwiżiti tal-valwazzjoni japplikaw għas-CCPs kif ukoll għal kontropartijiet li jirrapportaw oħra. Skont l-Artikolu 4(4) tal-abbozz tal-RTS dwar ir-rapportar, il-membri tal-ikklerjar huma meħtieġa jseguw l-valwazzjoni tas-CCP. Madankollu, dan ma jimplikax li s-CCPs jistgħu jistabbilixxu standards li jiddevjaw - is-CCPs għandu jikkonformaw mar-rekwiżiti stabbiliti fl-ITS u fl-RTS dwar ir-rapportar u jseguw l-gwida pprovduta fil-Linji Gwida jew fil-Q&As.
279. Għal xi kuntratti, il-valwazzjoni tinbidel b'mod mhux frekwenti u tista' ma tinbidilx minn ġurnata għal oħra. Madankollu, il-kwalità tad-data ma tibbenefikax mill-eċċezzjonijiet u jkun diffiċli li tiddistingwi l-każijiet ta' valwazzjoni stabbli min-nuqqas ta' rapportar tal-valwazzjonijiet, għalhekk il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-valwazzjonijiet ta' kuljum anki għal dawn il-kuntratti (f'konformità mal-Artikolu 2 tal-ITS dwar ir-rapportar). Ir-rekwiżit li tiġi rrapportata valwazzjoni ta' kuljum japplika anki meta l-valwazzjoni tkun żero, irrISPettivament mill-mudell użat.
280. L-ewwel valwazzjoni ta' derivattiv partikolari għandha tiġi rrapportata sal-aħħar tal-ġurnata wara l-konklużjoni tad-derivattiv (data tal-għeluq tar-rapportar), fir-rapport oriġinali bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" jew f'rapport separat bit-tip ta' azzjoni "Valwazzjoni".
281. Mhuwiex meħtieġ li l-valwazzjoni tiġi rrapportata fl-aħħar ġurnata ta' derivattiv. B'mod partikolari, mhuwiex meħtieġ li l-valwazzjoni tiġi rrapportata għad-derivattivi tal-istess ġurnata (jiġifieri derivattivi li huma konklużi u terminati fl-istess ġurnata).
282. Meta l-kontropartijiet jirrapportaw il-pakketti magħmula minn żewġ derivattivi jew iktar, il-valwazzjoni għandha tkun irrapportata għal kull derivattiv.

#### Metodu ta' valwazzjoni

283. Il-metodu ta' valwazzjoni għandu jiġi rrapportat f'konformità mal-metodu applikat għad-determinazzjoni tal-valwazzjoni. Dan ifisser li n-negozji kklerjati mis-CCP għandu jkollhom metodu ta' valwazzjoni li jindika li l-valwazzjoni tas-CCP hija rrapportata. Jekk mill-inqas input wieħed tal-valwazzjoni jintuża li jkun ikklassifikat bħala valwazzjoni skont mudell fit-tabella ta' hawn taħt, mela l-valwazzjoni kollha għandha tiġi kklassifikata bħala valwazzjoni skont mudell. Jekk jintużaw inputs biss li huma kklassifikati bħala metodu ta' valwazzjoni skont is-suq fit-tabella ta' hawn taħt, mela l-valwazzjoni kollha għandha tiġi kklassifikata bħala valwazzjoni skont is-suq.

**TABELLA 17 - Klassifikazzjoni tal-inputs tal-valwazzjoni**

| Taqsim | Inputs użati                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Metodu ta' valwazzjoni                                                                                        |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1      | <p>Prezzijiet ikkwotati fis-swieq attivi għal assi jew obligazzjonijiet identiċi li l-entità tista' taċċessa fid-data tal-kejl [IFRS 13:76]. Prezz tas-suq ikkwotat f'suq attiv jipprovdi l-iktar evidenza affidabbli ta' valur ġust u jintuża mingħajr aġġustament biex ikejjel il-valur ġust meta disponibbli, b'eċċezzjonijiet limitati. [IFRS 13:77]</p> <p>Suq attiv huwa suq li fih iseħħu t-tranzazzjonijiet għall-assi jew għall-obbligazzjoni bi frekwenza u b'volum suffiċjenti biex jipprovdu informazzjoni dwar l-ipprezzar fuq bażi kontinwa. [IFRS 13: Appendiċi A]</p> | Metodu ta' valwazzjoni skont is-suq                                                                           |
| 2      | Prezzijiet ikkwotati għal assi jew obligazzjonijiet simili fi swieq attivi [IFRS 13:81] (minbarra prezzijiet tas-suq ikkwotati inklużi fit-taqsim 1 li jistgħu jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni, direttament jew indirettament)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | Metodu ta' valwazzjoni skont is-suq                                                                           |
| 3      | Prezzijiet ikkwotati għal assi jew obligazzjonijiet simili fi swieq li mhumiex attivi [IFRS 13:81] (minbarra prezzijiet tas-suq ikkwotati inklużi fit-taqsim 1 li jistgħu jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni, direttament jew indirettament).                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | Metodu ta' valwazzjoni skont mudell – prezzijiet storiċi minn swieq inattivi m'għandhomx jintużaw direttament |
| 4      | Inputs minbarra l-prezzijiet ikkwotati li jistgħu jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni, pereżempju r-rati tal-imġħax u kurvi tar-rendiment li jistgħu jiġu osservati f'intervalli kkwotati b'mod komuni, volatilità implikata, firxiet tal-kreditu [IFRS 13:81] (minbarra prezzijiet tas-suq ikkwotati inklużi fit-taqsim 1 li                                                                                                                                                                                                                                           | Metodu ta' valwazzjoni skont is-suq                                                                           |

**TABELLA 17 - Klassifikazzjoni tal-inputs tal-valwazzjoni**

| Taqsim | Inputs użati                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | Metodu ta' valwazzjoni                                                                                                                                                                                |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | jistgħu jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni, direttament jew indirettament)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                       |
| 5      | Inputs li ġejjin prinċipalment mid- <i>data</i> dwar is-suq li tista' tiġi osservata jew ikkorroborata minnha jew mezzi oħra ("inputs ikkorroborati mis-suq") [IFRS 13:81] (minbarra prezzijiet tas-suq ikkwotati inklużi fit-taqsim 1 li jistgħu jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni, direttament jew indirettament)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | Metodu ta' valwazzjoni skont mudell – l-inputs jistgħu jiġu "prinċipalment" mid- <i>data</i> dwar is-suq li tista' tiġi osservata, jiġifieri li inputs li ma jistgħux jiġu osservati jistgħu jintużaw |
| 6      | Inputs li ma jistgħux jiġu osservati għall-assi jew għall-obbligazzjoni. [IFRS 13:86] L-inputs li ma jistgħux jiġu osservati jintużaw sabiex jitkejjel il-valur ġust safejn l-inputs li jistgħu jiġu osservati rilevanti ma jkunux disponibbli, biex b'hekk jiġu kkunsidrati sitwazzjonijiet fejn ikun hemm ftit, jekk ikun hemm, attività fis-suq għall-assi jew għall-obbligazzjoni fid- <i>data</i> tal-kejl. Entità tiżviluppa inputs li ma jistgħux jiġu osservati bl-użu tal-aqwa informazzjoni disponibbli fiċ-ċirkostanzi, li tista' tinkludi d- <i>data</i> tal-entità stess, filwaqt li titqies l-informazzjoni kollha dwar is-suppożizzjonijiet dwar il-parteċipanti fis-suq li hija raġonevolment disponibbli. [IFRS 13:87-89] | Metodu ta' valwazzjoni skont mudell – jintużaw inputs li ma jistgħux jiġu osservati                                                                                                                   |

### Delta

284. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw id-delta ta' derivattivi b'opzjoni jew bi swapzjoni, fil-livell tan-negożju jew tal-pożizzjoni, fil-kamp 2.25. Il-valur rapportabbli huwa l-proporzjon tal-bidla assoluta fil-prezz (jew fil-valur) ta' derivattiv għall-bidla fil-prezz (jew fil-valur) tas-sottostanti. Id-delta rapportata m'għandhiex tkun aġġustata, jiġifieri l-valur irrapportat m'għandux jinkludi aġġustamenti relatati ma' eż. ir-riskju ta' kreditu tal-kontroparti.

285. Is-CCPs, il-kontropartijiet finanzjarji u l-kontropartijiet mhux finanzjarji msemija fil-Artikolu 10 tal-EMIR għandhom jużaw il-messaġġi “Aġġornament tal-valwazzjoni” biex jirrapportaw il-valur tad-delta kif ikun fl-aħħar ta’ kull ġurnata. Fil-prattika dan ifisser li daww il-kontropartijiet biss li huma meħtieġa jibagħtu l-aġġornamenti tal-valwazzjoni huma meħtieġa jaġġornaw il-valur tad-delta kuljum.
286. Il-kontropartijiet minbarra daww imsemija fil-paragrafu ta’ hawn fuq mhumiex meħtieġa jirrapportaw id-delta.
287. Il-valur tad-delta jista’ jvarja minn -1 sa 0 għall-opzjonijiet ta’ bejgħ u minn 0 sa 1 għall-opzjonijiet ta’ xiri. Il-valuri delta rapportabbli huma proporzjonijiet, li jfisser li m’għandhomx unità (eż. munita). Fil-każ li opzjoni eżotika (bħal opzjoni binarja jew knock-in/out) ikollha delta ta’ inqas minn -1 jew iktar minn 1, -1 jew 1, għandha tiġi rapportata, rispettivament.
288. Għall-każ speċifiku tas-swapzjonijiet, delta għandha tinftiehem bħala l-proporzjon bejn il-bidla fil-valur tal-iswapzjoni għall-bidla fil-valur tal-iswap sottostanti.
289. Għall-opzjonijiet tal-basket, delta m’għandhiex tiġi rapportata.

### **3.19 Rapportar tal-marġni**

290. Il-kategoriji tal-kollateralizzazzjoni għandhom jiġu rapportati f’konformità mal-Artikolu 5 tal-ITS dwar ir-rapportar.
291. Il-kamp “Kollateralizzazzjoni” għandu jimtela fuq il-bażi tal-ftehim u mhux fuq il-kollateral attwali skambjat, jiġifieri jekk il-ftehim jikkunsidra għal marġni inizjali u marġni ta’ varjazzjoni bidirezzjonali, il-kamp għandu jimtela b’“FLCL” anki jekk is-sitwazzjoni attwali tista’ tkun li l-ebda marġni inizjali jew marġni ta’ varjazzjoni ma tiġi skambjata.
292. It-tabella ta’ hawn taħt turi xenarji differenti ta’ kollateralizzazzjoni u kif għandhom jiġu rrapportati bl-użu tal-kategoriji.

**TABELLA 18 - KATEGORIJI TA' KOLLATERALIZZAZZJONI**

| Nr. | Scenarios                                       |    |      |    | Reporting of 'Collateralisation' |        |
|-----|-------------------------------------------------|----|------|----|----------------------------------|--------|
|     | Collateral to be posted (acc. to the agreement) |    |      |    | CP A                             | CP B   |
|     | CP A                                            |    | CP B |    | report                           | report |
|     | IM                                              | VM | IM   | VM |                                  |        |
| 1   | -                                               | -  | -    | -  | UNCL                             | UNCL   |
| 2   | -                                               | Y  | -    | -  | PRC1                             | PRC2   |
| 3   | -                                               | -  | -    | Y  | PRC2                             | PRC1   |
| 4   | -                                               | Y  | -    | Y  | PRCL                             | PRCL   |
| 5   | Y                                               | Y  | -    | -  | OWC1                             | OWC2   |
| 6   | -                                               | -  | Y    | Y  | OWC2                             | OWC1   |
| 7   | Y                                               | Y  | -    | Y  | OWP1                             | OWP2   |
| 8   | -                                               | Y  | Y    | Y  | OWP2                             | OWP1   |
| 9   | Y                                               | Y  | Y    | Y  | FLCL                             | FLCL   |

\*UNCL – mhux kollateralizzat, PRC1 – Parzjalment kollateralizzat: Kontroparti 1, PRC2 - Parzjalment kollateralizzat: Kontroparti 2, PRCL - Parzjalment kollateralizzat, OWC1 - Kollateralizzat b'mod unilaterali: Kontroparti 1 biss, OWC2 - Kollateralizzat b'mod unilaterali: Kontroparti 2 biss, OWP1 – Kollateralizzat b'mod unilaterali/parzjalment kollateralizzat: Kontroparti 1, OWP2 – Kollateralizzat b'mod unilaterali/parzjalment kollateralizzat: Kontroparti 2, FLCL– Kompletament kollateralizzat

293. Kif speċifikat fl-Artikolu 4.2 tal-RTS dwar ir-rapportar, il-kollateral jista' jiġi rapportat fuq bażi ta' portafoll. Dan ifisser li r-rapportar ta' kull derivattiv wieħed imwettaq m'għandux jinkludi l-kampijiet kollha relatati mal-kollateral, safejn kull derivattiv wieħed ikun assenjat għal portafoll speċifiku u l-informazzjoni rilevanti dwar il-portafoll tkun rapportata kuljum (fl-aħħar tal-ġurnata).
294. Il-kontropartijiet li jirrapportaw, irrispettivament mill-ħtieġa tagħhom li jirrapportaw il-kollateral, jeħtieġ li jipprezentaw mill-inqas rapport tal-marġni wieħed (kamp 3.28 "Tip ta' azzjoni" mimli b'"Ġdid"), anki biex juri li l-kuntratt tad-derivattiv mhuwiex kollateralizzat. Jekk "UNCL" ikun l-aħħar valur ipprezentat, l-ebda aġġornament tal-marġni ieħor mhuwa mistenni. Għal dettalji rigward il-ġenerazzjoni tar-rapport dwar l-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa, jekk jogħġbok ara t-taqsima 6.3.2.
295. Mhuwiex meħtieġ li l-marġni jiġu rapportati fl-aħħar ġurnata ta' derivattiv. B'mod partikolari, mhuwiex meħtieġ li l-marġni jiġu rapportati għad-derivattivi tal-istess ġurnata (jiġifieri derivattivi li huma konklużi u terminati fl-istess ġurnata).
296. Meta l-mudell Settle-to-Market japplika l-iskopertura tal-metodu ta' valwazzjoni skont is-suq tiġi saldata u risettjata għal zero kuljum u l-marġni ta' varjazzjoni jithallas mingħajr possibbiltà ta' redditu. F'dak il-każ, huwa permissibbli li jiġi rapportat marġni ta' varjazzjoni zero. Il-valuri ta' wara l-haircut tal-marġni jiddependu mir-riskju assoċjat tat-tibdil fil-valur tal-kollateral u għalhekk min-natura tal-kollateral depożitat (jew miġbur). Barra minn hekk, saldu fi flus kontanti

frekwenti tal-marġni jista' effettivament itaffi r-riskju kompletament. Il-valuri ta' qabel u ta' wara l-haircut għandhom jiġu rapportati t-tnejn. Jekk ir-riskju jittaffa kompletament madankollu, l-istess valuri huma mistennija għall-valuri ta' qabel u ta' wara l-haircut.

297. Hemm biss kamp wieħed tal-munita tal-kollateral assoċjat ma' tip ta' kollateral f'rapport minn kontroparti. Għalhekk, il-kollateral kollu għal tip ta' kollateral ta' portafoll uniku għandu jiġi rapportat f'valur tal-munita unika wieħed għat-tip ta' kollateral korrispondenti. Il-kontroparti li tirrapporta għandha tirrapporta l-munita li ġiet maqbula kuntrattwalment bejn il-kontropartijiet. Jekk il-munita ma ġietx maqbula kuntrattwalment, il-kontroparti li tirrapporta hija libera li tiddeċiedi liema munita għandha tintuża bħala munita bażi sakemm il-munita bażi magħżula tkun waħda mill-muniti ewlenin li jirrapprezentaw l-ikbar piż fil-grupp u tintuża b'mod konsistenti għall-iskop li jiġi rrapportat il-kollateral għal portafoll partikolari.
298. Kollateral mhux fi flus kontanti għandu jiġi rrapportat bħala l-ekwivalenti fi flus kontanti attwali tiegħu kif evalwat fil-mument tad-depożitu/tal-ġbir tal-kollateral.
299. Il-kollateral irrapportat għandu jkun biss il-kollateral li jkopri l-iskopertura relatata mar-rapporti magħmula skont l-EMIR. Jekk huwa impossibbli li fi grupp ta' kollateral jiġi distint l-ammont relatat mad-derivattivi rapportabbli skont l-EMIR mill-ammont relatat ma' tranżazzjonijiet oħra, il-kollateral irrapportat jista' jkun il-kollateral attwali depożitat li jkopri grupp iktar wiesgħa ta' tranżazzjonijiet.
300. It-tifsira ta' "impossibbli li jiġi distint" għandha tiġi riferuta għall-qafas adottat mill-kontropartijiet li jirrapportaw għall-kalkolu tal-marġni (u mhux biss għall-użu ta' kont ta' marġni komuni). B'mod partikolari, l-ANKs jistennu l-approċċ li ġej:
- Jekk il-mudell tal-marġni adottat mill-kontroparti li tirrapporta jipprovdi għattnaqquis tar-riskji bejn id-derivattivi rapportabbli skont l-EMIR u t-tranżazzjonijiet li mhumiex rapportabbli skont l-EMIR, mela r-rapportar tal-ammont tal-kollateral komuni għandu jkun permess;
  - Jekk il-marġni relatati mad-derivattivi rapportabbli skont l-EMIR u l-marġni relatati mat-tranżazzjonijiet li mhumiex rapportabbli skont l-EMIR huma biss miġbura (u miżmuma) flimkien f'kont tal-kollateral komuni, iżda kkalkolati separatament, mela l-ammont tal-kollateral relatat mad-derivattivi EMIR biss għandu jiġi rrapportat.
301. Il-kollateral għandu jiġi rrapportat bħala l-valur tas-suq totali li ġie ddepożitat jew miġbur mill-kontroparti responsabbli mir-rapport. Il-fatt li xi tipi ta' kollateral jistgħu jieħdu numru ta' granet biex jilħqu l-kontroparti l-oħra għandu jiġi injorat. Għalhekk, l-aġġornamenti tal-marġni għandhom jiġu rapportati meta jsiru effettivi, jiġifieri fid-data tas-saldu mistennija u għandhom jinkludu kwalunkwe marġni li jkun fi tranżitu u saldu pendenti, mingħajr ma jitqiesu fallimenti tas-saldu temporanji.
302. Minkejja li d-data tal-marġni mhijiex kamp rikonċiljabbli, il-marġni rapportati mill-kontropartijiet għandhom ikunu konsistenti.
303. L-RTS dwar ir-rapportar jispeċifika li fejn il-kollateral relatat ma' kuntratt huwa rapportat fuq bażi ta' portafoll, il-kontroparti li tirrapporta għandha tirrapporta lir-

repożitorju tat-tranzazzjonijiet kodiċi li jidentifika l-portafoll relatat mal-kuntratt irrapportat. Dan il-kamp għandu jimtela biss jekk il-kamp “Indikatur tal-portafoll tal-kollateral” ikollu l-valur “Iva”. Hija l-kontroparti li tirrapporta li għandha tiddetermina liema valur uniku timla fil-kamp “Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral”. Għalhekk, il-kontropartijiet differenti f’kuntratt tad-derivattiv jistgħu jużaw kodiċijiet tal-portafoll tal-kollateral differenti.

304. L-ITS dwar ir-rapportar jispeċifika li l-kamp 3.27 “Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral” jista’ jkollu sa 52 karattru alfanumeriku u li karattri speċjali mhumiex awtorizzati. Għalhekk, il-kodiċi tal-portafoll tal-kollateral li għandu tul ta’ inqas minn 52 karattru huwa permissibbli sakemm jissodisfa l-kriterji l-oħra msemmija hawnhekk.
305. Huwa permissibbli li jintuża valur f’dan il-kamp li jingħata mis-CCP, iżda dan mhuwiex meħtieġ u valuri oħra jistgħu jintużaw.
306. Madankollu, l-ANKs jistennu li l-portafolli rapportati miż-żewġ kontropartijiet, irrispettivament mill-kodiċijiet, ikopru l-istess kollateral.
307. Il-kollateral eċċessiv għandu jiġbor biss kollateral addizzjonali li jiġi depożitat jew riċevut separatament u indipendentement mill-marġni inizjali u ta’ varjazzjoni. Jekk il-kontropartijiet jiddeċiedu jiddepożitaw iktar kollateral milli meħtieġ u dan il-kollateral addizzjonali ma jiġix depożitat separatament u indipendentement mill-marġni ta’ varjazzjoni u mill-marġni inizjali, iż-żewġ kontropartijiet għandhom jinkludu dan fil-marġni inizjali u jew ta’ varjazzjoni rapportati.
308. Għalkemm f’ċerti ċirkostanzi l-ebda kollateral ma jiġi skambjat, pereżempju minħabba l-eżistenza ta’ “Ammont ta’ Trasferiment Minimu” (MTA), ftehim jew limiti oħra għat-trasferiment tal-kollateral bejn il-partijiet, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw l-ammont tal-marġni li ma nbidilx mill-ġurnata ta’ qabel. Jista’ jkun li fl-ewwel ġurnata meta derivattiv jiġi konkluż, il-marġni ta’ varjazzjoni jkun żero. Għalhekk, f’dan il-każ speċifiku, jekk fil-ġranet ta’ wara MTA jew limiti oħra maqbula bejn il-partijiet ma jintlaħqux, marġni ta’ varjazzjoni għandhom jiġu rrapportati mill-ġurnata ta’ qabel, jiġifieri l-kampijiet tal-marġni ta’ varjazzjoni għandhom jimtlew b’żero.
309. F’ċerti ċirkostanzi, id-derivattivi jiġu eżentati mill-iskambju tal-kollateral skont l-EMIR, b’mod partikolari (1) meta NFC- tkun kontroparti f’derivattiv, (2) meta par kontropartijiet jibbenefika minn eżenzjoni tal-intragrupp mill-iskambju tal-kollateral jew (3) għal ċerti derivattivi skont l-RTS 2016/2251 bħal (i) kuntratti forward tal-kambju u swaps saldati b’mod fiżiku u (ii) opzjonijiet ta’ ekwità ta’ stokk uniku / opzjonijiet tal-indiċi skont id-dispożizzjoni tranżizzjonali sal-4 ta’ Jannar 2024. F’dawn il-każijiet, għalkemm il-kontropartijiet mhumiex meħtieġa jiskambjaw il-kollateral, il-kontropartijiet huma xorta waħda permessi li jkollhom stabbilit ftehim ta’ kollateral u għandhom jirrapportaw kif xieraq lill-ftehim ta’ kollateral applikabbli (jiġifieri “UNCL” biss jekk l-ebda ftehim ta’ kollateral ma jkun stabbilit u l-ebda kollateral ma jiġi skambjat). Barra minn hekk, il-kontropartijiet li huma meħtieġa jirrapportaw il-kollateral (jiġifieri CCPs, FCs u NFC+) huma mistennija jirrapportaw l-ammont attwali tal-kollateral li huwa skambjat. Meta par kontropartijiet jibbenefika

minn eżenzjoni tal-intragrupp mir-rapportar, il-kontropartijiet m'għandhom jirrapportaw la d-derivattivi u lanqas il-kollateral.

310. Il-marġni ta' varjazzjoni depożitat jew dak miġbur għandu jiġi rrapportat, mhux it-tnejn. Jekk jogħġbok irreferi għall-eżempju pprovdut fit-tabella u t-test li jagħti spjegazzjoni taht it-tabella.
311. B'mod ġenerali, il-kontropartijiet u s-CCPs huma meħtieġa jirrapportaw il-valur totali tal-kuntratt u l-marġni. Skont il-mudell STM, li tahtu l-marġni ta' varjazzjoni jiġu saldati ta' kuljum, il-kontropartijiet u s-CCPs għandhom jirrapportaw il-bidla ta' kuljum fil-valur tal-marġni ta' varjazzjoni.
312. Ir-rekwiżiti tar-rapportar tal-marġni japplikaw għas-CCPs kif ukoll għal kontropartijiet li jirrapportaw oħra. Sabiex tiġi żgurata l-konsistenza, il-membri tal-ikklerjar jistgħu jseguw l-marġni rapportati mis-CCP.

**TABELLA 19 RAPPORTAR TAL-MARĠNI**

| Data  | CP 1 | CP 2 | Marġni inizjali depożitat qabel il-haircut | Marġni ta' varjazzjoni depożitat qabel il-haircut | Marġni inizjali depożitat wara l-haircut | Marġni ta' varjazzjoni depożitat wara l-haircut | Marġni inizjali riċevut qabel il-haircut | Marġni ta' varjazzjoni riċevut qabel il-haircut | Marġni inizjali riċevut wara l-haircut | Marġni ta' varjazzjoni riċevut wara l-haircut | Livell |
|-------|------|------|--------------------------------------------|---------------------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|----------------------------------------|-----------------------------------------------|--------|
| Jum 1 | A    | B    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 10,000,000                                      |                                        | 5,000,000                                     | P      |
| Jum 1 | B    | A    |                                            | 10,000,000                                        |                                          | 5,000,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 2 | A    | B    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 10,000,000                                      |                                        | 5,000,000                                     | P      |
| Jum 2 | B    | A    |                                            | 10,000,000                                        |                                          | 5,000,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 3 | A    | B    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 8,000,000                                       |                                        | 4,000,000                                     | P      |
| Jum 3 | B    | A    |                                            | 8,000,000                                         |                                          | 4,000,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 4 | A    | B    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 13,000,000                                      |                                        | 6,500,000                                     | P      |
| Jum 4 | B    | A    |                                            | 13,000,000                                        |                                          | 6,500,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 5 | A    | B    |                                            | 7,000,000                                         |                                          | 3,500,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 5 | B    | A    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 7,000,000                                       |                                        | 3,500,000                                     | P      |
| Jum 6 | A    | B    |                                            | 2,000,000                                         |                                          | 1,000,000                                       |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 6 | B    | A    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 2,000,000                                       |                                        | 1,000,000                                     | P      |
| Jum 7 | A    | B    |                                            | 0                                                 |                                          | 0                                               |                                          |                                                 |                                        |                                               | P      |
| Jum 7 | B    | A    |                                            |                                                   |                                          |                                                 |                                          | 0                                               |                                        | 0                                             | P      |

313. “Rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni” huwa determinat bħala l-ammont tal-marġni dovuti mill-kontroparti “bid-dejn” sabiex tkopri l-iskopertura tagħha kontra l-kontroparti “bil-kreditu” fil-ħin tal-valwazzjoni tal-kuntratt.

314. Barra minn hekk, wieħed jassumi li:

- a. Haircut ta’ 50 % japplika għall-kollateral skambjat bejn il-kontropartijiet.
- b. Il-kontroparti “bid-dejn” trid tagħti lill-kontroparti “bil-kreditu” ammont ta’ kollateral li l-valur ta’ wara l-haircut tiegħu huwa l-istess bħar-“rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni”.
- c. Ammont ta’ Trasferiment Minimu (MTA) ta’ 500,000 huwa maħsub li huwa stabbilit bħala limitu għat-trasferiment tal-kollateral.
- d. Jekk id-differenza bejn ir-“rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni” u l-kollateral depożitat (marġni ta’ varjazzjoni wara l-haircut) hija inqas mill-MTA, l-ebda kollateral mhuwa skambjat bejn il-kontropartijiet.
- e. Jekk id-differenza bejn ir-“rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni” u l-kollateral depożitat (marġni ta’ varjazzjoni wara l-haircut) jaqbeż l-MTA, iseħħ skambju ta’ kollateral bejn il-kontropartijiet.

**Jum 1:** Minhabba l-valwazzjoni tal-kuntratt, rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni ta’ 5 miljuni għandu jiġi depożitat minn B għal A.

B jiddepożita ammont ta’ kollateral li l-valur ta’ wara l-haircut tiegħu huwa daqs 5 miljuni (marġni ta’ varjazzjoni depożitat/riċevut wara l-haircut = 5 miljuni; marġni ta’ varjazzjoni riċevut/depożitat qabel il-haircut = 10 miljuni).

**Jum 2:** Il-valwazzjoni tal-kuntratt tirriżulta fi tnaqqis tar-rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni dovut minn B minn 5 miljuni għal 4.9 miljuni.

Peress li l-ammont li A jkollu jibgħat lura lil B (biex jallinja l-kollateral depożitat minn B mat-talba tal-marġni ta’ varjazzjoni) huwa inqas mill-MTA (5 miljuni – 4.9 miljuni = 100,000 < MTA = 500,000), ma jseħħ l-ebda skambju ta’ marġni.

Il-Marġni ta’ Varjazzjoni rapportati huma l-istess bħal ta’ Jum 1.

**Jum 3:** Il-valwazzjoni tal-kuntratt tirriżulta fi tnaqqis ulterjuri tar-rekwiżit tal-marġni ta’ varjazzjoni dovut minn B minn 4.9 miljuni għal 4 miljuni.

Id-differenza bejn il-valur aġġornat tar-“rekwiżit tal-marġni tal-varjazzjoni” u l-kollateral depożitat huwa daqs 1 miljun (900,000 mill-jum 3 + 100,000 mill-jum 2).

Peress li tali differenza taqbeż l-MTA, iseħħ it-trasferiment tal-kollateral: A jibgħat lura lil B kwantità tal-kollateral li l-valur ta’ wara l-haircut tiegħu huwa 1 miljun.

Il-valuri aġġornati tal-marġni ta’ varjazzjoni huma rapportati kif xieraq (marġni tal-varjazzjoni riċevut/depożitat wara l-haircut = 4 miljuni; marġni ta’ varjazzjoni depożitat/riċevut qabel il-haircut = 8 miljuni).

**Jum 4:** Il-valwazzjoni tal-kuntratt tirriżulta f'żieda tar-rekwiżit tal-marġni ta' varjazzjoni dovut minn B minn 4 miljuni għal 6.5 miljuni.

Peress li tali differenza taqbeż l-MTA, iseħħ it-trasferiment tal-kollateral: B jiddepożita kollateral addizzjonali lil A sabiex jissodisfa r-rekwiżit tal-marġni ta' varjazzjoni għdid.

Il-valuri aġġornati tal-marġni ta' varjazzjoni depożitati/riċevuti huma rapportati kif xieraq (marġni ta' varjazzjoni riċevut/depożitat wara l-haircut = 6.5 miljuni; marġni tal-varjazzjoni depożitat/riċevut qabel il-haircut = 13-il miljun)

**Jum 5:** Il-valwazzjoni tal-kuntratt tirriżulta f'tibdil fid-direzzjoni tal-iskopertura: il-kuntratt isir negattiv għal A, li jrid ikopri rekwiżit tal-marġni ta' varjazzjoni daqs 3.5 miljuni.

Għalhekk, A jibgħat lura lil B l-ammont sħiħ tal-kollateral depożitat preċedentement minn B. Min-naħa tiegħu, A jiddepożita lil B kollateral addizzjonali li l-valur ta' wara l-haircut tiegħu ikun ta' 3.5 miljuni. Peress li tali differenza taqbeż l-MTA, iseħħ it-trasferiment tal-kollateral.

Il-valuri aġġornati tal-marġni tal-varjazzjoni huma rapportati kif xieraq: A jsir il-kontroparti li tiddepożita l-kollateral (marġni ta' varjazzjoni depożitat qabel il-haircut = 3.5 miljuni; valur tal-marġni ta' varjazzjoni depożitat qabel il-haircut = 7 miljuni) u B jsir il-kontroparti li tirċievi l-kollateral (marġni ta' varjazzjoni riċevut wara l-haircut = 3.5 miljuni; marġni ta' varjazzjoni riċevut qabel il-haircut = 7 miljuni)

**Jum 6:** A jnaqqas l-iskopertura tiegħu lil B billi jbigħ parzjalment il-kuntratt. Konsegwentement, il-valwazzjoni tal-kuntratt tirriżulta fi tnaqqis tar-rekwiżit tal-marġni ta' varjazzjoni dovut minn A minn 3.5 miljuni għal 1 miljun.

Il-valuri aġġornati tal-marġni ta' varjazzjoni huma rapportati kif xieraq (marġni tal-varjazzjoni depożitat/riċevut wara l-haircut = 1 miljun; marġni ta' varjazzjoni riċevut/depożitat qabel il-haircut = 2 miljuni)

**Jum 7:** A u B innettjaw il-pożizzjoni għal zero u għalhekk, jiskambjaw il-marġni kollha pendenti, u jirrapportaw zero fil-kampijiet tal-marġni ta' varjazzjoni. Jekk il-kontropartijiet għalqu l-pożizzjoni, ma jkunx meħtieġ li jirrapportaw il-marġni fl-aħħar gurnata tad-derivattiv.

315. Dwar ir-rapportar tal-valur tal-kollateral għall-ETDs, fil-każ partikolari meta d-ditta tal-investment ma tkunx involuta fil-proċess ta' gbir u/jew ta' depożitu ta' kwalunkwe kollateral għall-klijent minħabba l-arranġamenti diretti bejn il-klijent u l-membri tal-ikklerjar, id-ditta tal-investment mhijiex mistennija tippreżenta xi rapport dwar il-valur tal-kollateral, jew dwar kwalunkwe modifika kif ukoll terminazzjoni sussegwenti tal-kuntratt tad-derivattiv konkluż.

### 3.20 Identifikazzjoni taċ-ċentru tan-negozjar

316. Il-kamp 2.41 “Ċentru tal-eżekuzzjoni” għandu jintuża biex jiġi rapportat iċ-ċentru fejn id-derivattiv twettaq, minkejja l-kwalifika tat-tranzazzjoni bħala ETD jew OTC.
317. Meta derivattiv ġie konkluż OTC u l-istrument rispettiv ma jkunx ammess għan-negozju jew innegozjat f’ċentru tan-negozjar u ma tkun saret l-ebda talba għall-ammissjoni, il-kodiċi MIC “XXXX” għandu jintuża.
318. Meta derivattiv ġie konkluż OTC u l-istrument rispettiv ikun ammess għan-negozju jew innegozjat f’ċentru tan-negozjar u tkun saret talba għall-ammissjoni, il-kodiċi MIC “XOFF” għandu jintuża.
319. Il-valur “BILT” propost fil-gwida taċ-ĊŻI għandu jintuża meta l-kontroparti li tirrapporta ma tistax tiddetermina jekk l-istrument huwiex elenkat jew le, skont ir-rekwiżiti ġurisdizzjonali. Madankollu, din is-sitwazzjoni m’għandhiex titqajjem fl-UE peress li l-istrumenti kollha ammessi għan-negozju jew innegozjati f’ċentru tan-negozjar isiru disponibbli għall-pubbliku fis-Sistema ta’ Data ta’ Referenza tal-Istrumenti Finanzjarji (FIRDS) fuq is-sit web tal-ESMA <sup>24</sup>, u għalhekk il-kontropartijiet huma mistennija li jkunu kapaċi jiddeterminaw jekk għandhomx jirrapportaw “XOFF” jew “XXXX” u l-valur “BILT” mhuwiex permess fir-rapportar skont l-EMIR.
320. Għall-kuntratti tad-derivattivi nnegozjati fi swieq regolati jew f’ċentri tan-negozjar f’pajjiż terz meqjusa bħala ekwivalenti għal suq regolat, il-Kodiċi MIC ta’ segment se jkun meħtieġ (jew b’mod alternattiv l-MIC operattiv fil-każ li l-kodiċi MIC ta’ segment ma jeżistix).
321. Għall-kuntratti tad-derivattivi nnegozjati fuq MTFs, OTFs, SIs u pjattaformi tan-negozjar organizzati barra l-Unjoni, il-kodiċi MIC ta’ segment se jkun meħtieġ (jew b’mod alternattiv l-MIC operattiv fil-każ li l-kodiċi MIC ta’ segment ma jeżistix), anki jekk id-derivattivi konklużi f’dawn iċ-ċentri huma derivattivi OTC skont id-definizzjoni stabbilita fl-EMIR.
322. It-tranzazzjonijiet imwettqa taht jew skont ir-regoli taċ-ċentri għandhom jitqiesu bħala negozjar fiċ-ċentru għall-RMs jew ċentri f’pajjiż terz meqjusa bħala ekwivalenti, MTFs, OTFs, Sis u pjattaformi tan-negozjar organizzati barra l-Unjoni. Pereżempju, it-tranzazzjonijiet bħal tranzazzjonijiet negozjati b’mod bilaterali jew irrangati minn qabel skont ir-regoli ta’ ċentru, għandhom jiġu rapportati bl-identifikatur tal-pjattaforma rilevanti.
323. Il-kodiċijiet MIC huma definiti minn ISO 10383. Dan l-istandard jidentifika żewġ tipi ta’ kodiċi MIC: “MIC” u “MIC operattiv”, magħrufa wkoll bħala “MIC ta’ segment” u “MIC ta’ organizzazzjoni” rispettivament. Għar-rapporti tal-EMIR, l-RMs, l-MTFs, l-OTFs u l-SIs għandhom jiġu identifikati mill-kodiċi MIC rilevanti kif definit fir-Registru tal-ESMA fuq <http://registers.esma.europa.eu/publication> (kodiċi MIC ta’ segment). Iċ-ċentri l-oħra għandhom jiġu identifikati bl-użu tal-MICs ta’ segment

---

<sup>24</sup> [https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma\\_registers\\_firds](https://registers.esma.europa.eu/publication/searchRegister?core=esma_registers_firds)

(jew b'mod alternattiv bil-MIC operattiv fil-każ li l-kodiċi MIC ta' segment ma jeżistix).

324. Fil-każ li żewġ SIs jiffaċċjaw lil xulxin, dawk iż-żewġ kontropartijiet għandhom jiddeterminaw liema minnhom qed taġixxi fil-kapaċità ta' SI għat-tranzazzjoni partikolari u jirrapportaw il-kodiċi MIC ta' dik il-kontroparti bħala l-identifikatur taċ-ċentru.
325. L-ESMA tfakkar li d-derivattivi mwettqa fis-swieq regolati tar-Renju Unit qabel il-Brexit jitqiesu ETD. Madankollu, id-derivattivi mwettqa fis-swieq regolati tar-Renju Unit wara l-Brexit jitqiesu OTC. Il-kamp "Ċentru tal-eżekuzzjoni" xorta waħda jiġi identifikat bil-kodiċi MIC korrispondenti. Madankollu, tali tranzazzjonijiet għandhom jiġu dikjarati bħala OTC u kampijiet oħra bħall-kamp "Intragrupp" u l-kamp "Obbligu tal-ikklerjar" huma meħtieġa.

### **3.21 Kampijiet relatati mal-ikklerjar**

326. Fir-rigward tal-kamp "Ikklerjat", skont l-ITS dwar ir-rapportar, żewġ statuses biss huma permessi, b'mod partikolari kklerjat ("Iva") u mhux ikklerjat ("Le").
327. F'xi swieq, CCP testendi "offerta miftuħa" biex taġixxi bħala kontroparti għall-partiċipanti fis-suq u tidhol bejn il-partiċipanti fil-ħin li jitwettaq in-negozjar (mudell ta' offerta miftuħa). Fi swieq oħra, il-partiċipanti stess inizzjalment ikunu l-kontropartijiet. Sussegwentement, in-negozji jistgħu jiġu ppreżentati lil CCP, li hija sostitwita bħala l-bejjiegħ għax-xerrej u x-xerrej għall-bejjiegħ (mudell ta' kklerjar ta' novazzjoni).
328. L-Artikolu 2 tal-RTS dwar ir-rapportar jippreskrivi li meta kuntratt derivattiv li d-dettalji tiegħu diġà ġew irrapportati skont l-Artikolu 9 tal-EMIR jiġi sussegwentement ikklerjat minn CCP, dak il-kuntratt għandu jiġi rrapportat bħala terminat bl-użu tat-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni". Il-kuntratti ġodda li jirriżultaw mill-ikklerjar għandhom jiġu rrapportati bit-tip ta' azzjoni "Ġdid".
329. L-istess Artikolu jipprevedi wkoll li meta kuntratt ikun kemm konkluz f'ċentru tan-negozjar kif ukoll ikklerjat fl-istess ġurnata minn CCP, il-kuntratti li jirriżultaw mill-ikklerjar biss għandhom jiġu rrapportati (mudell ta' kklerjar ta' novazzjoni). Jekk l-ikklerjar ma jseħx fl-istess ġurnata, il-proċess tar-rapportar stabbilit fil-paragrafu preċedenti għandu jiġi applikat.
330. Fir-rigward tad-derivattivi mwettqa fiċ-ċentru ta' pajjiżi terzi u kklerjati minn CCP fl-istess ġurnata, l-Artikolu 2(2) mill-RTS dwar ir-rapportar jispeċifika li fejn derivattiv ikun kemm konkluz f'ċentru tan-negozjar jew f'pjattaforma ta' negozjar organizzata stabbilita barra l-Unjoni u kklerjat minn CCP fl-istess ġurnata, id-derivattivi li jirriżultaw mill-ikklerjar biss għandhom jiġu rrapportati. Dawn id-derivattivi għandhom jiġu rrapportati billi jiġu speċifikati l-kampijiet "Tip ta' azzjoni" u "Tip ta' event" bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u bit-tip ta' event "Ikklerjar", jew bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", f'konformità mal-Artikolu 3(2).
331. Il-kronogramma tal-eżekuzzjoni għan-negozji kklerjati għandha tikkorrispondi għall-ħin tal-eżekuzzjoni fiċ-ċentru tal-eżekuzzjoni. Il-kronogramma tal-ikklerjar

għandha tiġi rrapportata bħala l-ħin li fih is-CCP legalment ħadet ir-responsabbiltà tal-ikklerjar tan-negozju. Għas-swieg fejn l-ikklerjar iseħħ bl-użu tal-mudell ta' offerta miftuħa, il-kronogramma tal-eżekuzzjoni u l-kronogramma tal-ikklerjar użata huma mistennija li jkunu l-istess. Għas-swieg fejn l-ikklerjar iseħħ bl-użu tan-novazzjoni, dawn iż-żewġ kronogrammi jistgħu jkunu differenti.

332. Il-kamp "Obbligu tal-ikklerjar" mhuwix applikabbli għad-derivattivi mwettqa f'suq regolat jew suq ekwivalenti f'pajjiż terz u għandu jithalla vojt. Fil-każ tan-negozji kklerjati, dan il-kamp għandu jimtela b'"UKWN" u l-kamp "Ikklerjat" b'"Iva".
333. Il-kamp "Kontroparti ċentrali" għandu jimtela biss bl-identifikatur ta' CCP, jiġifieri kontroparti ċentrali li tissodisfa d-definizzjoni tal-Artikolu 2(1) tal-EMIR. Għalhekk, meta kuntratt tad-derivattiv jiġi kklerjat minn entità li mhijiex CCP skont it-tifsira tal-EMIR, il-kamra tal-ikklerjar m'għandhiex tiġi identifikata fil-kamp "Kontroparti ċentrali".
334. Meta derivattiv jitwettaq f'suq anonimizzat u kklerjat minn kamra tal-ikklerjar, il-kontroparti li twettaq id-derivattiv għandha titlob liċ-ċentru tan-negozjar jew lill-kamra tal-ikklerjar li tqabbel il-kontropartijiet biex tikxef l-identità tal-kontroparti l-oħra qabel id-data tal-għeluq tar-rapportar.

### 3.22 Kampijiet relatati mal-konferma

335. Id-data u l-ħin tal-konferma, kif determinati skont l-Artikolu 12 tal-RTS dwar l-arranġamenti tal-ikklerjar jiformaw il-"Kronogramma tal-konferma" li għandha tiġi rrapportata fil-kamp 2.28, il-mezzi ta' konferma għandhom jiġu rrapportati fil-kamp 2.29 "Konfermat".
336. Il-rekwiżit ta' konferma f'waqtha japplika biss għall-kuntratti OTC mhux ikklerjati (il-kronogramma tal-konferma u l-mezzi ta' konferma m'għandhomx jiġu rrapportati la għall-ETDs u lanqas għad-derivattivi OTC ikklerjati). Japplika kull darba li jiġi konkluz kuntratt tad-derivattiv ġdid, inklużi bħala riżultat tan-novazzjoni u kompressjoni tal-portafoll ta' kuntratti konkluzi preċedentement. Dan ir-rekwiżit ma japplikax għat-terminazzjonijiet sakemm it-terminazzjoni ma tneħħix l-obbligi kollha li jifdal fir-rigward ta' dak id-derivattiv. Il-kampijiet "Konfermat" u "Kronogramma tal-konferma" għandhom jiġu aġġornati u rrapportati kif xieraq sakemm ikunu meħtieġa għal negozju partikolari.
337. Għall-kamp "Konfermat", il-valur "NCNF" (mhux konfermat) għandu jintuża meta d-derivattiv ikun irid jiġi konfermat mill-kontropartijiet iżda jkun għadu ma ġiex konfermat.
338. F'każijiet oħra, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-valur "ECNF" jew "YCNF" għal dan il-kamp skont il-mezzi ta' konferma użati (elettroniċi jew mhux elettroniċi) u l-kamp "Kronogramma tal-konferma" għandu jimtela. Jekk jintuża l-valur "NCNF", il-kamp "Kronogramma tal-konferma" għandu jithalla vojt.
339. Fil-każ ta' negozji mwettqa f'ċentri ta' pajjiżi terzi li mhumiex ekwivalenti għas-suq regolat, daww in-negozji jitqiesu OTC skont ċerti dispożizzjonijiet tal-EMIR. Dan ifisser li l-kampijiet "Kronogramma tal-konferma" u "Konfermat" għandhom jiġu

rapportati sakemm dawn in-negozji ma jiġux ikklierjati. Fil-każ tad-derivattivi konkluzi fiċ-ċentru (mhux ikklierjati) li għalihom in-negozjar jissoponi l-aċċettazzjoni tat-termi tat-tranżazzjoni bejn il-partijiet, jekk id-derivattiv OTC ikun dokumentat u maqbul awtomatikament, għandu jitqies bħala konfermat elettronikament (il-kamp “Konfermat” jimtela b’“ECNF”). Għall-kuntrarju, jekk id-derivattiv OTC ikollu bżonn iktar dokumentazzjoni biex ikun jista’ jiġi maqbul, għandu jitqies bħala mhux konfermat (il-kamp “Konfermat” jimtela b’“NCNF”).

### 3.23 Kampijiet relatati mas-saldu

340. Il-kamp “Munita tas-saldu” għandu jimtela għal derivattivi ta’ munita unika saldati bil-flus kontanti, kif ukoll għal dawk b’komponent tas-suq tal-muniti barranin speċifiku. Il-kamp m’għandux jimtela fil-każ ta’ derivattiv saldat b’mod fiżiku. Il-kamp “Munita tas-saldu” għandu jkun speċifiku għal kull komponent tal-prodotti multivaluta.
341. Eżempju tal-mod kif għandha tiġi rapportata l-munita tas-saldu għaž-żewġ komponenti ta’ swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju ġie inkluż fit-taqsima 4.4.
342. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-muniti validi skont l-istandard ISO 4217. Il-muniti li mhumiex koperti mill-istandard ISO mhux se jiġu aċċettati, u għalhekk il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-valuri rilevanti fil-muniti onshore rilevanti rikonoxxuti fl-istandard ISO.

### 3.24 Rapportar tal-pagamenti regolari

343. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw biss dawk il-kampijiet relatati mal-elementi tad-*data* tal-pagamenti regolari li huma applikabbli għal derivattiv partikolari. Għalhekk, filwaqt li jqis it-tip ta’ kuntratt, ir-rapport ikun fih informazzjoni dwar kampijiet dedikati speċifiċi għal kull komponent fiss jew varjabbli ta’ derivattiv. L-istess regola tapplika għall-elementi tad-*data* li jiddeskrivu l-frekwenza tar-risetjar u l-perjodu ta’ referenza għar-rati varjabbli.
344. Għal kull komponent ta’ derivattiv b’pagamenti perjodiċi, ir-rata fissa trid tiġi rapportata, fejn applikabbli, billi jiġu speċifikati l-valuri pożittivi jew negattivi espressi bħala perċentwali (eż. 2.57 minflok 2.57 %).
345. Fil-każ ta’ komponenti varjabbli, il-pagamenti perjodiċi huma kalkolati abbażi ta’ rata ta’ referenza sottostanti f’dati definiti minn qabel. Ir-rati varjabbli għandhom jiġu identifikati, fejn disponibbli, b’ISIN u/jew b’kodiċi standardizzati b’4 ittri, inkluż esplicitament fl-ITS dwar ir-rapportar.
346. Barra minn hekk, ir-rati varjabbli għandhom dejjem jiġu identifikati bl-użu tal-isem uffiċjali tar-rata kif mogħtija mill-fornitur tal-indiċi.
347. M’hemm l-ebda aspettattivi biex il-valur tal-perjodu ta’ frekwenza tal-pagamenti jiġi trasformat f’perjodu ta’ frekwenza tal-pagamenti ieħor. Pereżempju, fil-każ ta’ pagamenti annwali, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw frekwenza ta’ pagament ta’ sena, iktar milli ta’ 12-il xahar jew 365 ġurnata.

### 3.25 Rapportar ta' pagamenti oħra

348. Il-pagament tal-primjums tal-opzjoni mhuwiex inkluż bħala tip ta' pagament ieħor, peress li l-primjums tal-opzjoni huma rrapportati billi jintuża l-element tad-*data* dedikat għall-primjums tal-opzjoni.
349. It-tariffi tan-novazzjoni mhumex inklużi fl-RTS dwar ir-rapportar bħala flussi tal-flus kontanti relatati mad-derivattivi bejn l-entitajiet li mhumex skedati regolarment. Għalhekk, it-tariffi tan-novazzjoni wkoll ma jistgħux jiġu rrapportati bħala pagamenti oħra.
350. Il-valuri permessi għal tipi ta' pagament oħra huma:
- UFRO = Pagament bil-quddiem, jiġifieri l-pagament inizjali magħmul minn waħda mill-kontropartijiet jew biex tranżazzjoni tingħieb fil-valur ġust jew inkella għal kwalunkwe raġuni oħra li jaf tkun il-kawża ta' tranżazzjoni barra mis-suq;
  - UWIN = Xoljiment jew Terminazzjoni kompluta, jiġifieri l-pagament tas-saldu finali li jsir meta tranżazzjoni tiġi xolta qabel id-data tat-tmiem tagħha; pagamenti li jistgħu jirriżultaw minhabba terminazzjoni kompluta ta' tranżazzjoni(jiet) ta' derivattiv;
  - PEXH = Skambju prinċipali, jiġifieri skambju ta' valuri nozzjonali għal swaps bejn il-muniti.
351. L-informazzjoni pprovduta f'kampijiet ta' pagament oħra għandha tiġi rrapportata biss għall-avveniment li jista' jiġi rrapportat li miegħu huwa relatat il-pagament u malli d-dettalji tal-pagament jiġu rrapportati, il-valuri m'għandhomx jippersistu fir-rapporti tal-avvenimenti sussegwenti kollha rrapportati mill-kontroparti għal dak in-negozju.
352. Għalhekk, jekk derivattiv jinvolvi kemm pagamenti bil-quddiem u ta' xoljiment, il-kontroparti għandha tirrapporta s-sekwenza tal-pagamenti fir-rapporti sussegwenti, kif ġej:

| TABELLA 20      |                       |                        |
|-----------------|-----------------------|------------------------|
| Tip ta' azzjoni | Tip ta' event         | Tip ieħor ta' pagament |
| Ġdid            | Negozju               | UFRO                   |
| Terminazzjoni   | Terminazzjoni bikrija | UWIN                   |

353. L-elementi tad-*data* relatati mal-"pagamenti oħra" jistgħu jiġu rrapportati iktar minn darba, għal iktar minn pagament wieħed.
354. Fil-każ tal-iskambju tal-valuri nozzjonali għall-iswaps bejn il-muniti, l-informazzjoni relatata mal-pagamenti għandha tiġi rrapportata fl-istess ħin li l-kuntratt tad-derivattiv jiġi rrapportat għall-ewwel darba, permezz tar-rapport "NEWT".

### 3.26 Kampijiet tad-dati u tal-kronogrammi

#### Data effettiva

355. Id-data effettiva hija d-data li fiha l-obbligi skont id-derivattiv jidhlu fis-sehħ, kif inkluż fil-konferma. Jekk il-kontropartijiet ma speċifikawx id-data effettiva bħala parti mit-termini tal-kuntratt, il-kamp “Data effettiva” għandu jimtela bid-data tal-eżekuzzjoni tad-derivattiv.
356. Dan japplika wkoll għad-derivattivi ta’ komoditajiet saldati bil-flus kontanti kif ukoll fil-każ tan-novazzjonijiet.
357. Il-kronogramma tal-eżekuzzjoni għandha tirrifletti d-data u l-ħin meta d-derivattiv oriġinarjament twettaq. Għalhekk, m’għandhiex tinbidel meta l-kontropartijiet jirrapportaw l-avvenimenti taċ-ċikli tal-ħajja (eż. terminazzjoni parzjali) għal derivattiv partikolari.

#### Data ta’ skadenza / data ta’ terminazzjoni bikrija

358. Id-data ta’ skadenza hija d-data mhux aġġustata li fiha l-obbligi skont id-derivattiv jieqfu jkunu effettivi, kif inkluż fil-konferma. It-terminazzjoni bikrija ma taffettwax dan l-element tad-data. Id-data ta’ skadenza tista’ tintuża biex jiġi determinat jekk in-negozju huwiex pendent jew le. Il-kontenut ta’ dan il-kamp fil-każ ta’ negozji mhux ikkonfermati għandu jiġi speċifikat fil-kuntratt bejn il-kontropartijiet.
359. Dan japplika kemm għad-derivattivi OTC kif ukoll għal daww ETD.
360. Skont l-Artikolu 9 tal-EMIR hemm dover li tiġi rapportata t-terminazzjoni. Madankollu, meta t-terminazzjoni sseħħ f’konformità mat-termini oriġinali tal-kuntratt, jista’ jiġi assunt li tali terminazzjoni ġiet oriġinarjament irrapportata, sakemm id-data ta’ skadenza ġiet irrapportata kif xieraq. Għalhekk, it-terminazzjonijiet li jseħħu f’d-data differenti biss għandhom jiġu rapportati.
361. Id-definizzjoni tal-kamp 2.44 “Data ta’ skadenza” fl-RTS dwar ir-rapportar tispeċifika li terminazzjonijiet bikrin ta’ derivattiv mhumieq riflessi f’dan il-kamp. Għalhekk, meta jinfetaħ kuntratt ġdid, il-kamp “Data ta’ skadenza” jirrappreżenta d-data oriġinali ta’ skadenza tal-kuntratt irrapportat. Madankollu, meta d-data ta’ maturità ta’ kuntratt eżistenti tkun soġġetta għal tibdil li diġà jkun previst fl-ispeċifikazzjonijiet tal-kuntratt oriġinali, il-kontropartijiet jibagħtu rapport ta’ modifika lill-entrata inizjali, billi jimmodifikaw il-kamp “Data ta’ skadenza” kif xieraq biex jirrifletti d-data ta’ skadenza aġġornata.
362. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw id-data ta’ skadenza mhux aġġustata, kif maqbul fil-kuntratt, anki jekk taqa’ fi tmiem il-ġimgħa jew f’vaganza bankarja.
363. L-eżempju ta’ hawn taħt jiċċara kif wieħed għandu jimla l-kamp “Data ta’ skadenza” għal derivattiv OTC Fiss jew Varjabbli għall-gass naturali bil-karatteristiċi li ġejjin:
- a. Data tan-negozju: 25-Aww-2017 Komodità: Gass Naturali

- b. Data effettiva: 01-Nov-2017
- c. Data tat-terminazzjoni: 31-Mar-2018
- d. Dati tal-pagament: Għaxart ijiem tan-negozju wara t-tmiem ta' kull perjodu ta' kalkolu soġġett għal
- e. aġġustament f'konformità mal-Konvenzjoni dwar il-Ġurnata tax-Xogħol ta' Wara Modifikata.

Id-data ta' skadenza korretta tkun il-31/03/2018 peress li din hija d-data tat-terminazzjoni miftiehma.

- 364. Il-paragrafi li ġejjin jiċċaraw kif "ġurnata ta' xogħol" għandha tiġi mifhuma għall-iskop li tiġi determinata data tal-għeluq għar-rapportar.
- 365. Il-kontropartijiet għandhom isegwu l-ħin lokali tagħhom biex jiddeterminaw il-ġurnata li fiha ġie konkluż, modifikat jew terminat id-derivattiv. Id-data tal-għeluq għar-rapportar hija t-tmiem tal-ġurnata ta' xogħol wara dik il-ġurnata. Id-determinazzjoni tad-data tal-għeluq għar-rapportar fil-ħin lokali ma taffettwax il-mod li fih id-dati u l-ħinijiet rilevanti (bħall-kronogramma tal-eżekuzzjoni) jiġu rrapportati lit-TRs. Il-konvenzjoni tal-ħin għar-rapportar hija definita fl-ITS dwar ir-rapportar.
- 366. Il-kontropartijiet għandhom isegwu l-kalendarju rilevanti tal-Istat Membru tagħhom biex jiddeterminaw jekk ġurnata partikolari hija jum ta' xogħol jew festa.
- 367. Din il-gwida tapplika wkoll meta ż-żewġ kontropartijiet fl-istess derivattiv isegwu kalendarji differenti u/jew jinsabu f'żoni ta' ħin differenti, li jfisser li kull kontroparti għandha ssegwi l-kalendarju lokali tagħha u tuża l-ħin lokali biex tiddetermina d-data tal-għeluq għar-rapportar.

### **3.27 Rapportar tad-derivattivi dwar il-kriptoassi**

- 368. Filwaqt li qies li l-iżviluppi li għaddejjin fir-regolamentazzjoni li attwalment qed jiġu diskussi dwar il-kriptoassi, l-RTS dwar ir-rapportar ma jistipula l-ebda rekwiżiti dettaljati fir-rigward tar-rapportar tad-derivattivi bbażati fuqhom. Madankollu, l-ESMA ddeċidiet li tinkludi fl-RTS dwar ir-rapportar kamp addizzjonali msemmi "Derivattiv ibbażat fuq il-kriptoassi" li fih il-kontropartijiet huma mistennija jindikaw jekk derivattiv partikolari huwiex ibbażat fuq kriptoassi jew le. Il-kamp huwa indikatur sempliċi mimli b'valur boolean. Dan se jippermetti l-valwazzjoni tal-volumi ta' negozjar u r-riskju pendenti f'dan it-tip ta' strumenti kif ukoll l-analiżi ta' kif dawn l-istrumenti huma attwalment rapportati.
- 369. Id-derivattivi fuq il-kriptoassi li jissodisfaw id-definizzjoni ta' derivattivi skont il-MiFID biss huma mistennija li jiġu rapportati (f'konformità mal-kamp ta' applikazzjoni ġenerali tar-rapportar skont l-EMIR).
- 370. Il-kampijiet tal-munita fir-rapportar tal-EMIR jippermettu biss li jimtlew bil-muniti elenkati fil-Kodiċi tal-Muniti ta' ISO 4217. Għalhekk, dawn il-kampijiet attwalment

m'għandhomx jimtlew bil-kodiċijiet relatati mal-kriptoassi li huma msemmija b'mod komuni "kriptoaluti".

371. L-ESMA tista' tiżviluppa gwida ulterjuri dwar tali derivattivi bbażati fuq il-kriptoassi ladarba r-regolamenti rilevanti ġew approvati.

### 3.28 Rapportar ta' prodotti kumplessi

372. F'konformità mal-Gwida CŽI CPMI-IOSCO, l-RTS dwar ir-rapportar introduċa kampijiet ġodda relatati mal-pakketti. Dan jinkludi l-kamp 2.6 "Identifikatur tal-pakkett", li għandu, min-naħa waħda, jintuża mill-kontropartijiet li jirrapportaw jew mill-entitajiet responsabbli mir-rapportar biex jirrapportaw bħala rabta unika bejn ir-rapporti li jappartjenu għall-istess kuntratt tad-derivattiv, fejn it-tabella tal-kampijiet ma tippermettix li jiġu ppreżentati d-dettalji f'rapport wieħed biss, u min-naħa l-oħra, fejn it-tranżazzjoni tal-pakkett tkun magħmula minn kombinament ta' kuntratti tad-derivattiv li huma negozjati flimkien bħala l-prodott ta' ftehim ekonomiku uniku (ara wkoll il-premessa 3 u 4 tal-RTS dwar ir-rapportar).

373. Filwaqt li hemm rekwiżit għaž-żewġ kontropartijiet biex jiftiehemu dwar in-numru ta' rapporti li għandhom jiġu preżentati għal kuntratt jew tranżazzjoni tal-pakkett partikolari u dwar il-UTIs assenjati lil daww ir-rapporti, m'hemm l-ebda ħtieġa li ż-żewġ kontropartijiet jiftiehemu dwar l-identifikatur. L-"Identifikatur tal-pakkett" se jkun uniku għal sett ta' rapporti li jappartjenu flimkien u li jiġu assenjati minn kull kontroparti li tirrapporta jew entità responsabbli mir-rapportar waħedhom. Għal din ir-raġuni m'hemm l-ebda ħtieġa li identifikatur tal-pakkett jiġi kkunsmat miċ-ċentri tan-negozjar jew mill-kontroparti l-oħra.

374. Tabella 21 turi r-rapportar tal-UTIs u tal-identifikaturi tal-pakkett fil-każ tat-tranżazzjonijiet tal-pakkett:

| TABELLA 21     |                    |                    |                    |                    |
|----------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|                | Rapport #1<br>CP 1 | Rapport #2 CP<br>1 | Rapport #1<br>CP 2 | Rapport #2<br>CP 2 |
| Kontroparti 1  | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 2       |
| Kontroparti 2  | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 1       |
| UTI            | 1234               | ABCD               | 1234               | ABCD               |
| ID tal-Pakkett | PCK1               | PCK1               | Pakkett987         | Pakkett987         |

375. Fil-każ li tranżazzjoni ta' pakkett tinkludi kuntratti rapportabbli u mhux rapportabbli, il-kuntratti li huma fil-kamp ta' applikazzjoni tal-Artikolu 9 tal-EMIR biss għandhom jiġu rrapportati. Pereżempju, kombinament ta' kuntratt spot tal-kambju u ta' kuntratt forward tal-kambju (li ma jitwettaqx bħala swap tal-valuti skont

ir-rata tal-kambju), il-kuntratt forward tal-kambju biss ikun fil-kamp ta' applikazzjoni tal-Artikolu 9 tal-EMIR u għalhekk rapportabbli. Madankollu, il-kampijiet relatati mal-pakkett kollu (eż. "Prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett") għandhom jimtlew biex jipprovdu lir-regolaturi ħarsa ħolistika dwar it-tranzazzjoni ta' pakkett imwettqa.

376. Jekk kuntratt tad-derivattiv jieqaf jeżisti, iżda jwelled kuntratt tad-derivattiv ieħor, li jkun materjalment differenti (eż. opzjoni fuq kuntratt tal-futuri), dawk iż-żewġ kuntratti għandhom jitqiesu b'mod individwali u ma jiġux irrapportati bħala tranzazzjoni ta' pakkett, għalhekk m'għandu jintuża l-ebda identifikatur tal-pakkett biex jorbot dawk ir-rapporti f'tali ċirkostanza, filwaqt li fl-istess ħin il-kamp "UTI preċedenti" jkun rilevanti u jeħtieġ li jiġi rrapportat.
377. Il-kamp tar-rapportar 2.53 "Prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett" u l-kamp 2.54 "Munita tal-prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett" għandhom jimtlew bil-prezz u bil-munita rilevanti għat-tranzazzjoni kollha ta' pakkett iktar milli l-prezz u l-munita tal-komponenti individwali. Jekk il-komponenti individwali jkollhom prezzijiet u muniti individwali, dawk għandhom jimtlew fir-rapport rilevanti fil-kamp 2.28 "Prezz" u fil-kamp 2.29 "Munita tal-prezz", flimkien mal-mili tal-kamp "Prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett".

| TABELLA 22                                  |                    |                    |                    |                    |
|---------------------------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|                                             | Rapport #1<br>CP 1 | Rapport #2 CP<br>1 | Rapport #1<br>CP 2 | Rapport #2<br>CP 2 |
| Kontroparti 1                               | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 2       |
| Kontroparti 2                               | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 2       | LEI ta' CP 1       | LEI ta' CP 1       |
| UTI                                         | 1234               | ABCD               | 1234               | ABCD               |
| ID tal-Pakkett                              | PCK1               | PCK1               | Pakkett987         | Pakkett987         |
| Prezz                                       | 10.23              | 210.75             | 10.23              | 210.75             |
| Munita tal-prezz                            | EUR                | EUR                | EUR                | EUR                |
| Prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett            | 220.98             | 220.98             | 220.98             | 220.98             |
| Munita tal-prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett | EUR                | EUR                | EUR                | EUR                |

378. Jista' jkun hemm sitwazzjonijiet meta prezz għat-tranzazzjoni f'pakkett isir disponibbli biss wara d-data tal-għeluq tar-rapportar (T+1). Jekk tali sitwazzjoni ssejtni, il-prezz tat-tranzazzjoni f'pakkett għandu jiġi rrapportat bil-valur awtomatiku definit, kif speċifikat fir-regoli ta' validazzjoni, u għandu jiġi aġġornat kif xieraq ladarba jsir disponibbli bl-użu ta' "MODI" fil-kamp 2.151 "Tip ta' azzjoni". ~~Sakemm~~
379. Fil-każ li l-prezz għal tranzazzjoni f'pakkett sħiħa jkun espress b'firxa, jiġifieri d-differenza bejn żewġ prezzijiet ta' referenza, tali firxa għandha timtela fil-kamp 2.112 "Firxa tat-tranzazzjoni f'pakkett" flimkien mal-kamp 2.113 "Munita tal-firxa tat-tranzazzjoni f'pakkett". Jekk tali firxa ma tkunx magħrufa fil-punt ta' hin tal-konklużjoni tat-tranzazzjoni f'pakkett, għandha tiġi rrapportata bl-inadempjenza speċifikata fir-regoli ta' validazzjoni u tiġi aġġornata iktar tard meta ssir magħrufa. Għal darb'oħra, dan l-aġġornament għandu jintbagħat billi jintuża "MODI" fil-kamp 2.151 "Tip ta' azzjoni".

### 3.29 L-iżgurar tal-kwalità tad-data mill-kontropartijiet

380. Skont l-Artikolu 9(1e) tal-EMIR, il-kontropartijiet u s-CCPs għandhom jirrapportaw b'mod korrett u mingħajr duplikazzjoni. Il-kwalità tad-data rrapportata mill-kontropartijiet hija aspett kruċjali biex jiġu żgurati l-utilizzabbiltà u l-kwalità tar-riżultati analitiċi tad-data. Iktar rekwiżiti għall-iżgurar tal-kwalità tad-data min-naħa tal-kontroparti huma stabbiliti fl-Artikolu 9 tal-ITS dwar ir-rapportar u fl-Artikolu 1 u 3 tal-RTS dwar il-kwalità tad-data.
381. Sabiex tiġi żgurata l-konformità mar-rekwiżit li r-rapportar ikun korrett, sabiex tiġi żgurata l-konsistenza tad-data, kif ukoll biex jinkisbu t-tnaqqis tal-piż tar-rapportar u l-allinjament tal-inċentivi mal-prioritajiet tal-entità stess, il-kontropartijiet għandhom jużaw id-data regolatorja għall-proċessi tal-ġestjoni tar-riskju u tal-konformità interni tagħhom stess.
382. Minbarra li jimplimentaw sett komuni ta' regoli ta' validazzjoni li jipprovdu tveġiba immedjata dwar il-kwalità tad-data fil-punt tas-sottomissjoni tad-data, it-TRs għandhom jimplimentaw proċess ta' rikonċiljazzjoni li jikkonsisti fit-tqeghid flimkien u fit-tqabbil tar-rapporti li jappartjenu liż-żewġ naħat tad-derivattiv biex iqabblu l-kontenut tar-rapporti u jindikaw l-inkonsistenzi billi jindikaw ir-rapportar hażin minn mill-inqas waħda mill-kontropartijiet. It-TRs għandhom jipprovdu informazzjoni dettaljata dwar ir-rifjuti u r-rikonċiljazzjoni lill-partecipanti u lill-utenti rilevanti tat-TR u wkoll lill-ANK. Il-kontropartijiet li jirrapportaw, l-entitajiet li jipprezentaw rapport u l-entitajiet responsabbli mir-rapportar, kif applikabbli, għandhom jinvestigaw il-problemi bil-kwalità tad-data indikati mir-rifjuti tar-rapporti u mir-rikonċiljazzjoni li ma rnexxiex, u jiżguraw il-korrezzjoni tad-data. L-ITS dwar ir-rapportar jeħtieġ ukoll b'mod speċifiku li l-entitajiet responsabbli mir-rapportar u l-entitajiet li jipprezentaw rapport, kif applikabbli, ikollhom fis-sejtni arranġamenti li jiżguraw li l-feedback dwar il-fallimenti tar-rikonċiljazzjoni pprovdut mit-TRs jitqies.

383. Dwar ir-rekords storiċi, il-kontropartijiet u l-ERRs huma mistennija jirrapportaw lura d-*data* kollha li tħalliet barra identifikata u jikkoreġu d-*data* kollha rrapportata ħażin lit-TRs.
384. Biex tikkomplimenta l-istatistika ta' rifjut u ta' rikonċiljazzjoni pprovduta mit-TRs lill-ANK, l-entità responsabbli mir-rapportar għandha tinnotifika minnufih (malli ssir konxja tagħha) lill-awtorità kompetenti tagħha u, jekk differenti, anki lill-awtorità kompetenti tal-kontroparti li tirrapporta bi kwalunkwe mis-sitwazzjonijiet li ġejjin:
- a. kwalunkwe rapportar ħażin ikkawżat minn difetti fis-sistemi ta' rapportar li jaffettwa għadd sinifikanti ta' rapporti,
  - b. kwalunkwe ostaklu għar-rapportar li jwaqqaf lill-entità li tippreżenta rapport milli tibgħat ir-rapporti lir-Repożitorju tat-Tranżazzjonijiet qabel l-iskadenza stabbilita fl-Artikolu 9 tal-EMIR.
  - c. kwalunkwe problema sinifikanti li tirriżulta fi żbalji fir-rapportar li ma tikkawżax rifjut minn repożitorju tat-tranżazzjonijiet f'konformità mal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*.
385. In-notifika għandha tindika mill-inqas l-informazzjoni bażika dwar u l-identifikazzjoni tan-notifika, l-ERR u l-RSE(s), il-kamp ta' applikazzjoni tar-rapporti affettwati, it-tip ta' żbalji jew tal-ommissjonijiet, ir-raġunijiet għall-iżbalji jew għall-ommissjonijiet, il-passi meħuda jew ipplanati biex isolvu l-problema, id-*data* tal-okkorrenza, l-iskeda ta' żmien għar-riżoluzzjoni tal-problema u s-sottomissjoni jew il-korrezzjoni tad-*data*. L-entità responsabbli mir-rapportar għandha tipprovdi n-notifika f'mudell komuni ppubblikat fuq is-sit web tal-ESMA.
386. Kull problema fil-kwalità tad-*data* identifikata għandha tiġi pprovduta f'notifika separata, sakemm ma jkunux identifikati diversi problemi fil-kwalità tad-*data* li jkunu relatati mill-qrib, eż. ikkawżati minn kawża komuni, bi skedi ta' żmien għar-riżoluzzjoni li jikkoinċidu jew tiswijiet ta' bugs komuni, jew b'xi mod ieħor interkonnessi u li huwa impossibbli li jiġu separati f'notifiki individwali. F'tali każ, huwa possibbli li tiġi pprovduta notifika unika għal dawn il-problemi kollha relatati tal-kwalità tad-*data*.
387. Il-valutazzjoni tas-sinifikanza għandha titwettaq malli l-kamp ta' applikazzjoni tar-rapportar ħażin jiġi identifikat u n-numru ta' rekords affettwati mill-problema tar-rapportar jiġi determinat. In-notifika lill-ANK għandha tintbagħat mingħajr dewmin bla bżonn wara li l-valutazzjoni tiġi konklufa u l-informazzjoni rilevanti kollha tingabar. Jekk wara l-ewwel valutazzjoni jiġu identifikati iktar rekords affettwati, valutazzjoni oħra għandha titwettaq u l-ANK għandhom jiġu notifikati b'aġġornament. Peress li l-valutazzjoni se titwettaq l-iktar fuq bażi ad hoc, l-ESMA ma tistennix li l-ERRs jipprovdu n-notifiki lill-awtoritajiet kompetenti fuq bażi regolari.
388. L-ESMA hija konxja mill-ħtieġa li tispeċifika f'iktar dettall il-metrika u l-limiti ewlenin biex tivvaluta l-kamp ta' applikazzjoni tan-notifiki, kif ukoll tal-ħtieġa li tikkalibra bir-reqqa l-proposta. Il-ħtieġa għal kjarifika tappartjeni b'mod partikolari għall-"għadd sinifikanti ta' rapporti" taħt il-punt a. u għall-"problema sinifikanti" taħt

il-punt c. hawn fuq. L-ESMA tipprovdi l-eżempji ta' hawn taħt tax-xenarji rilevanti u tiċċara l-metrika għall-valutazzjoni tal-kamp ta' applikazzjoni tan-notifiki.

389. Skont l-Artikolu 9(1)(a) tal-ITS dwar ir-rapportar, kwalunkwe rapportar ħażin ikkawżat minn difetti fis-sistemi ta' rapportar li jaffettwa għadd sinifikanti ta' rapporti għandu jiġi notifikat. Ir-rekwiżit japplika għal kwalunkwe difett fis-sistemi ta' rapportar fuq in-naħa tal-ERR jew tal-RSE, jew għal kwalunkwe sistema ta' rapportar ta' parti terza jekk tintuża l-esternalizzazzjoni. Dan ix-xenarju jinkludi pereżempju każijiet ta' problemi tekniċi li jeskludu perċentwal kbir ta' rekords mis-sottomissjoni, l-ommissjoni sistematika ta' ċerti kampijiet fir-rapporti, rapportar sistematiku ta' valuri żbaljati jew anormali fir-rapporti (eż. żbalji fis-sistema fl-ordnijiet tal-kampijiet numerici). Peress li r-rekwiżit li jiġu notifikati l-awtoritajiet japplika għall-ERR, għall-RSE jew għal kwalunkwe parti terza involuta fir-rapportar, għandhom jinformat l-ERRs kollha rilevanti jekk jesperjenzaw fallimenti fis-sistema jew jidentifikaw kwalunkwe difett ieħor fis-sistemi ta' rapportar tagħhom. L-RSE għandha tibgħat in-notifika lill-ANK biss jekk tkun ERR għal xi kontropartijiet jew kollha kemm huma li f'isimhom qed tirrapporta. Inkella, jekk l-RSE jew kwalunkwe parti terza involuta fir-rapportar tkun qed tesperjenza problemi bil-kwalità tad-*data*, għandha tinforma biss lill-ERRs rilevanti dwar id-dettalji tal-problema sabiex l-ERRs ikunu jistgħu jwettqu l-valutazzjoni tas-sinifikanza tal-problema. L-ERRs u l-RSEs huma mistennija jkollhom stabbilti kontrolli suffiċjenti fil-livell tal-proċessi tar-rapportar tad-*data* b'tali mod li kwalunkwe mill-problemi msemmija hawn fuq jiġu identifikati fil-ħin, rapportati lill-awtoritajiet u rranġati b'mod permanenti.
390. Għadd sinifikanti ta' rapporti għandu jiġi vvalutat separatament għal kull waħda mill-kategoriji li ġejjin:
- d. Kategorija 1 – rapporti bit-tipi ta' azzjoni "Ġdid", "Modifika", "Korrezzjoni", "Terminazzjoni", "Żball", "Ftuħ mill-ġdid", "Komponent ta' pożizzjoni",
  - e. Kategorija 2 – rapporti bit-tip ta' azzjoni "Valwazzjoni",
  - f. Kategorija 3 – rapporti bit-tip ta' azzjoni "Aġġornament tal-marġni".
391. Jekk in-numru tar-rapporti affettwati mill-problema tar-rapportar huwa sinifikanti f'mill-inqas waħda mill-kategoriji, l-awtoritajiet kompetenti għandhom jiġu notifikati bil-problema ta' rapportar.
392. In-numru ta' rapporti affettwati mir-rapportar ħażin huwa sinifikanti jekk jaqbeż il-limitu li ġej:

$$\text{NumTaRappAff} / \text{NumMedXahar} > Y \% \quad \text{u} \quad \text{NumTaRappAff} > X$$

$$\text{jigifieri } \text{NumTaRappAff} \geq \text{Limitu} = \text{mass} \{X; Y \% \text{ ta' NumMedXahar}\},$$

Meta X u Y huma kostanti ta' kalibru, u NumMedXahar huwa n-numru mensili medju ta' sottomissjonijiet ikkalkolat fil-ġurnata tal-valwazzjoni bħala

$$(\text{NumTaRapportiXahar}_{-12} + \text{NumTaRapportiXahar}_{-11} + \dots + \text{NumTaRapportiXahar}_{-2} + \text{NumTaRapportiXahar}_{-1}) / 12 = \text{NumTaRapportiL-aħħar12Xahar} / 12$$

bl-użu tan-numru attwali ta' rapporti pprezentati matul l-aħħar 12-il xahar.

393. Sabiex tqis kemm l-ERR jew l-RSE hi sinifikanti, l-ESMA għandha l-ħsieb li tispeċifika t-taqsimiet u l-kostanti ta' kalibru korrispondenti abbażi tan-numru medju ta' rapporti pprezentati kif muri fl-eżempju fit-Tabella 23.

394. Il-valutazzjoni tas-sinifikanza għandha titwettaq fil-livell tal-ERR jew fil-livell tal-RSE jekk applikabbli. L-RSE għandha twettaq il-valutazzjoni biss jekk hi ERR għal xi kontropartijiet jew kollha kemm huma li f'isimhom qed tirrapporta. Mhuwiex meqjus neċessarju li n-numru medju ta' sottomissjonijiet jiġi kkalkolat separatament għal kull kontroparti, jekk l-ERR jew l-RSE tirrapporta f'isem diversi kontropartijiet. Peress li l-intenzjoni tal-ESMA hi li jinqabdu problemi sistematiċi, anki jekk għal kontroparti unika jinqabeż il-limitu, għandha titqies l-istampa ġenerali fl-RSE. Ix-xenarji li ġejjin għandhom l-għan li jiffaċilitaw il-fehim.

395. Ejja nikkunsidraw it-taqsimiet u l-limiti li ġejjin:

| TABELLA 23                                                |                      |                              |                    |
|-----------------------------------------------------------|----------------------|------------------------------|--------------------|
| Numru medju ta' sottomissjonijiet fix-xahar (NumMedXahar) |                      |                              |                    |
|                                                           | $0 \leq A < 100,000$ | $100,000 \leq A < 1,000,000$ | $1,000,000 \leq A$ |
| X                                                         | 100                  | 20,000                       | 150,000            |
| Y %                                                       | 20 %                 | 15 %                         | 10 %               |

**Xenarju A:** Tliet kontropartijiet jistrieħu fuq l-istess Entità li Tippreżenta Rapport biex jipprezentaw ir-rapporti. L-RSE hija taħt il-limitu, kontroparti waħda qed taqbeż il-limitu.

| TABELLA 24        |                  |                     |                                  |                                      |                |
|-------------------|------------------|---------------------|----------------------------------|--------------------------------------|----------------|
|                   | Medja kull xahar | Rapporti affettwati | X                                | Y                                    | Limiti maqbuża |
| Cpt 1             | 1,000            | 10                  | $10 < 100$                       | $1 \% < 20 \%$                       | Le             |
| Cpt 2             | 1,000            | 250                 | $250 > 100$                      | $25 \% > 20 \%$                      | Iva            |
| Cpt 3             | 500              | 10                  | $10 < 100$                       | $2 \% < 20 \%$                       | Le             |
| <b>RSE totali</b> | <b>2,500</b>     | <b>270</b>          | <b><math>270 &gt; 100</math></b> | <b><math>11 \% &lt; 20 \%</math></b> | <b>Le</b>      |

Anki jekk għall-kontroparti 2 il-limiti jinqabżu, il-kalkolu fil-livell tal-RSE huwa taħt il-limitu u għalhekk m'hemm l-ebda bżonn li l-RSE tinnotifika lill-ANKs rilevanti. Madankollu, jekk l-RSE mhijiex ERR għall-kontropartijiet affettwati kollha, għandha tinforma kif xieraq l-ERRs kollha ta' daww il-kontropartijiet dwar il-problema bir-rapportar, sabiex ikunu jistgħu jivvalutaw is-sitwazzjoni ġenerali tagħhom u jinnotifikaw lill-ANK tagħhom jekk ikunu qed jinqabżu l-limitu.

**Xenarju B:** Tliet kontropartijiet jistrieħu fuq l-istess Entità li Tippiżżenta Rapport biex jippreżentaw ir-rapporti. L-RSE hija fuq il-limiti, żewġ kontropartijiet huma taħt il-limitu. L-RSE hija ERR biss għall-Cpt 2.

| TABELLA 25        |                  |                     |                                  |                                      |               |
|-------------------|------------------|---------------------|----------------------------------|--------------------------------------|---------------|
|                   | Medja kull xahar | Rapporti affettwati | X                                | Y                                    | Limitu maqbuż |
| Cpt 1             | 1,000            | 180                 | $180 > 100$                      | $18 \% < 20 \%$                      | Le            |
| Cpt 2             | 1,000            | 800                 | $800 > 100$                      | $80 \% > 20 \%$                      | Iva           |
| Cpt 3             | 500              | 10                  | $10 < 100$                       | $2 \% < 20 \%$                       | Le            |
| <b>RSE totali</b> | <b>2,500</b>     | <b>990</b>          | <b><math>990 &gt; 100</math></b> | <b><math>40 \% &gt; 20 \%</math></b> | <b>Iva</b>    |

L-RSE għandha problema sinifikanti, iżda Cpt 1 u Cpt 3 huma affettwati ftit biss. F'dan il-każ, in-notifika lill-ANK għandha tinkludi d-dettalji bħan-numru ta' rapporti affettwati, li huma relatati biss ma' Cpt 2.

Simili għax-xenarju ta' qabel, jekk l-RSE ma tkunx ERR għall-kontropartijiet affettwati kollha, għandha tinforma kif xieraq l-ERRs kollha ta' dawk il-kontropartijiet (f'dan ix-xenarju Cpt 1 u Cpt 3) dwar il-problema bir-rapportar, sabiex ikunu jistgħu jivvalutaw is-sitwazzjoni ġenerali tagħhom u jinnotifikaw lill-ANK tagħhom jekk ikunu qed jinqabżu l-limiti.

**Xenarju C:** Kontroparti (ERR) qed tiddelega r-rapportar lil 2 RSEs u tirrapporta parzjalment waħedha. Fil-livell tal-kontroparti, subsetta ta' rapporti biss huwa affettwat mill-problema bir-rapportar f'RSE.

| TABELLA 26        |                  |                                   |                                  |                                      |                |
|-------------------|------------------|-----------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------|----------------|
|                   | Medja kull xahar | Rapporti affettwati minn problema | X                                | Y                                    | Limiti maqbuża |
| Cpt               | 1,000            | 0                                 | $0 < 100$                        | $0 \% < 20 \%$                       | Le             |
| RSE 1             | 1,000            | 250                               | $250 > 100$                      | $25 \% > 20 \%$                      | Iva            |
| RSE 2             | 500              | 0                                 | $0 < 100$                        | $0 \% < 20 \%$                       | Le             |
| <b>ERR totali</b> | <b>2500</b>      | <b>250</b>                        | <b><math>250 &gt; 100</math></b> | <b><math>10 \% &lt; 20 \%</math></b> | <b>Le</b>      |

L-RSE1 potenzjalment għandha problema sinifikanti iżda fil-livell ġenerali tal-kontroparti, il-problema mhix sinifikanti. F'dan il-każ, il-kontroparti mhix mistennija tinnotifika lill-ANK tagħha. Madankollu, RSE 1 mhijiex ipprojbta milli tinnotifika lill-ANK tal-kontroparti jekk il-problema tkun sinifikanti fil-livell tal-RSE 1 u l-kontroparti tistrieħ fuq l-RSE 1 biex tinnotifika lill-ANKs.

396. Skont l-Artikolu 9(1)(b) tal-ITS dwar ir-rapportar, kwalunkwe ostaklu għar-rapportar li jwaqqaf lill-entità li tippreżenta rapport milli tippreżenta r-rapporti fid-data tal-għeluq tar-rapportar għandu jiġi notifikat. Dawn il-każijiet jinkludu primarjament fallimenti fis-sistema iżda m'għandhomx jiġu mifhuma bħala limitati biss għal problemi tekniċi, eż. problemi operattivi (COVID-19) nuqqas ta' aġġornament tal-LEI, impossibbiltà li jiġi ġġenerat il-UTI. Biex tkompli tagħmel differenza mill-każijiet ta' rapportar ħażin u ta' ommissjoni tar-rekords tal-Artikolu 9(1)(a), l-ESMA tenfasizza li l-każijiet skont l-Artikolu 9(1)(b) huma relatati mal-inabbiltà sħiħa li jintbagħtu kwalunkwe rekords lit-TRs, filwaqt li l-problemi tal-kwalità tad-data skont l-Artikolu 9(1)(a) jaffettwaw biss subsett ta' rekords rapportati.
397. Skont l-Artikolu 9(1)(c) tal-ITS dwar ir-rapportar, kwalunkwe problema sinifikanti li tirriżulta fi żbalji fir-rapportar li ma jikkawżawx ir-rifjut minn repożitorju tat-tranżazzjonijiet għandha tiġi notifikata.
398. Problema sinifikanti skont l-Artikolu 9(1)(c) tal-ITS dwar ir-rapportar għandha tiġi vvalutata skont il-lista mhux eżawrjenti li ġejja ta' kriterji kwalitattivi:
- Nuqqas ta' rapportar jew rapportar eċċessiv ta' derivattiv minħabba valutazzjoni żbaljata tar-rapportabbiltà tagħha;
  - Interpretazzjoni żbaljata jew inkonsistenti tan-numru ta' rapporti li għandhom jiġu rrapportati għal derivattiv speċifiku (eż. f'tilwima mal-kontroparti l-oħra);
  - Interpretazzjoni żbaljata jew inkonsistenti tal-kontenut tal-kampijiet (eż. f'tilwima mal-kontroparti l-oħra);
  - Rapportar ta' derivattivi mhux standard li għalihom il-kampijiet mhumex kompletament adatti;
  - Żbalji u ommissjonijiet relatati ma'
    - Data żbaljata fl-identifikazzjoni tal-partijiet: kampijiet 1.2 sa 1.16, 1.20, 2.33, 2.37;
    - Dettalji tan-negozji żbaljati: kampijiet 1.17 sa 1.19, 2.1 sa 2.12, 2.38 sa 2.41;
    - Dettalji żbaljati dwar is-sottostanti: kampijiet 2.13 sa 2.18 – b'mod partikolari meta l-basket ma jkunx komplet;
    - Ammonti u muniti fil-kampijiet kollha relatati (nozzjonali, valwazzjoni, kollateral, prezz, eżerċitar...);
    - Dati / kronogrammi: eżekuzzjoni, konferma tal-event, skadenza;
    - Kampijiet tal-ikklerjar 2.30 sa 2.32;

- vii. Dettalji tar-rapport żbaljati: kampijiet 2.151, 2.152 u 2.154;
  - viii. Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral: kamp 3.9;
  - ix. Żbalji fil-metodi tal-valwazzjoni li jirriżultaw f'rapportar żbaljat tal-valwazzjoni.
399. Problema sinifikanti skont l-Artikolu 9(1)(c) tal-ITS dwar ir-rapportar għandha tiġi vvalutata iktar (b'mod kumulattiv) skont il-kriterji kwantitattivi li jispeċifikaw numru sinifikanti ta' rekords affettwati mill-problema fil-kwalità tad-*data* sinifikanti b'mod kwalitattiv. Xenarji ta' eżempju t'hawn fuq japplikaw b'mod analugu għal problemi sinifikanti skont l-Artikolu 9(1)(c) tal-ITS dwar ir-rapportar.
400. L-entità responsabbli mir-rapportar għandu jkollha proċessi stabbiliti biex tkun tista' fi kwalunkwe ħin tivvaluta s-sinifikanza tal-każijiet identifikati ta' rapportar hażin kif deskritt hawn fuq u biex tinnotifikahom minnufih lill-ANK rilevanti. B'mod speċifiku, dan jinkludi l-identifikazzjoni rapida tar-rekords affettwati u n-numri tagħhom u l-komputazzjoni tal-metrika rilevanti biex jivvalutaw jekk il-limiti nqabżux jew le.
401. Il-kontropartijiet, l-ERRs jew l-RSEs jeħtieġ li jipprezentaw in-notifiki tagħhom lill-ANK f'konformità mal-proċeduri adottati minn dawk l-ANK f'kull Stat Membru.
402. Hawn problema fil-kwalità tad-*data* huma relatati mal-interpretazzjoni inkonsistenti tar-regoli għar-rapportar tad-derivattivi. L-għan ta' dawn il-Linji Gwida huwa li jipprovdu, fit-taqsimiet rilevanti, il-gwida meħtieġa għad-diversi xenarji ta' rapportar u kuntratti tad-derivattivi, inklużi eżempji illustrattivi dettaljati.
403. Il-mili tal-kampijiet li huma speċifikati bħala fakultattivi fir-regoli ta' validazzjoni ma jithallix għad-diskrezzjoni tal-kontropartijiet li jirrapportaw. Il-kampijiet fakultattivi għandhom dejjem jimtlew fil-każijiet kollha meta l-kamp huwa rilevanti fix-xenarju partikolari jew għad-derivattiv partikolari.

## 4 Rapportar għal kull tip ta' prodott

404. Din it-taqsimha tinkludi kjarifiki u eżempji li juru r-rapportar ta' ċerti prodotti tad-derivattivi.
405. L-eżempji huma pprovduti fl-għamla ta' tabelli, fejn kull tabella turi l-kampijiet ta' rapportar skont l-ITS dwar ir-rapportar. Il-kolonna "Kamp" turi kull isem tal-kamp, u l-kolonna "Eżempju" tipprovdi eżempju ta' dak li jiġi inkluż f'dak il-kamp. Il-kolonna finali intitolata "Messagg XML" turi l-format tal-messagg XML li għandu jiġi pprezentat fir-rapport.
406. Sakemm ma jiġix iddikjarat mod ieħor fix-xenarju speċifiku, l-informazzjoni ta' sfond li ġeja tapplika għax-xenarji kollha stabbiliti f'din it-taqsimha:

|                                                                                                   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Il-kontroparti A hija kontroparti finanzjarja Ġermaniża identifikata bil-LEI 12345678901234500000 |
| Il-kontroparti B hija kontroparti finanzjarja Taljana identifikata bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST   |
| Il-kontroparti C hija NFC- Spanjola identifikata bil-LEI 123456789ABCDEFGHIJK                     |

Il-kontroparti D hija NFC+ Franciża identifikata bil-LEI 11223344556677889900

Il-kontroparti J ta'gixxi wkoll b'hala membru tal-ikklerjar u hija identifikata bil-LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

Is-CCP O hija identifikata bil-LEI BBBBBBBBBBBB1111111111

## 4.1 Rapportar tal-lswap ta' rata tal-imghax

407. Meta jiġi rapportat swap ta' rata tal-imghax, il-kontropartijiet għandhom jiddeskrivu r-rati sottostanti fissi jew varjabbli fil-kampijiet dedikati tar-rata għall-komponent 1 u għall-komponent 2 (kampijiet 2.79-2.110), iktar milli eż. jipprovdu r-rata varjabbli fil-kamp tal-indiċi sottostanti.

408. Hemm tliet kampijiet distinti biex tiġi deskritta rata varjabbli:

- Identifikatur (kampijiet 2.83 u 2.99), li għandu jimtela b'ISIN,
- Indikatur (kampijiet 2.84 u 2.100) li għandu jimtela b'kodiċi b'4 ittri standardizzati, u
- Isem (kampijiet 2.85 u 2.101), li għandu jimtela bl-isem sħiħ tar-rata.

409. Il-kontropartijiet għandhom dejjem jirrapportaw l-ISIN u l-kodiċi b'4 ittri, sakemm ikunu disponibbli għal rata partikolari. L-isem tar-rata għandu jiġi rapportat fil-każijiet kollha.

Swaps bejn muniti differenti tar-rati tal-imghax minn fissi għal varjabbli

410. Swap bejn muniti differenti tar-rati tal-imghax minn fiss għal varjabbli ta' 5 snin fuq 3M EURIBOR vs 0.5 % (bl-ebda firxa addizzjonali). Il-kontropartijiet jiskambjaw il-pagamenti kull sitt xhur u l-frekwenza tar-risettjar tiġi stabbilita għal annwali. Il-konvenzjoni għall-għadd tal-jiem hija Attwali/360.

| Tabella 27 – Rapportar ta' swap bejn muniti differenti tar-rati tal-imghax minn fiss għal varjabbli |                                                                             |         |                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                 | Kamp                                                                        | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                |
| 79                                                                                                  | Rata fissa tal-komponent 1 jew tal-kupun                                    | 0.5     | <pre> &lt;IntrstRate&gt;   &lt;FrstLeg&gt;     &lt;Fxd&gt;       &lt;Rate&gt;         &lt;Rate&gt;0.5&lt;/Rate&gt;       &lt;/Rate&gt;     &lt;DayCnt&gt;       &lt;Cd&gt;A004&lt;/Cd&gt;           </pre> |
| 80                                                                                                  | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1 | A004    |                                                                                                                                                                                                            |

| Tabella 27 – Rapportar ta' swap bejn muniti differenti tar-rati tal-imgħax minn fiss għal varjabbli |                                                                                                   |                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                 | Kamp                                                                                              | Eżempju                           | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 81                                                                                                  | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1                   | KULL XAHAR                        | <pre> &lt;/DayCnt&gt; &lt;PmtFrqcy&gt;   &lt;Term&gt;     &lt;Unit&gt;MNTH&lt;/Unit&gt;     &lt;Val&gt;6&lt;/Val&gt;   &lt;/Term&gt; &lt;/PmtFrqcy&gt; &lt;/Fxd&gt; &lt;/FrstLeg&gt; &lt;ScndLeg&gt;   &lt;Fltg&gt;     &lt;Id&gt;EU0009652783&lt;/Id&gt;     &lt;Nm&gt;Euro Interbank Offered Rate&lt;/Nm&gt;     &lt;Rate&gt;       &lt;Cd&gt;EURI&lt;/Cd&gt;     &lt;/Rate&gt;     &lt;RefPrd&gt;       &lt;Unit&gt;MTH&lt;/Unit&gt;       &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt;     &lt;/RefPrd&gt;     &lt;Sprd&gt;       &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;     &lt;/Sprd&gt;     &lt;DayCnt&gt;       &lt;Cd&gt;A004&lt;/Cd&gt;     &lt;/DayCnt&gt;     &lt;PmtFrqcy&gt;       &lt;Term&gt;         &lt;Unit&gt;MNTH&lt;/Unit&gt;         &lt;Val&gt;6&lt;/Val&gt;       &lt;/Term&gt;     &lt;/PmtFrqcy&gt;     &lt;RstFrqcy&gt;       &lt;Term&gt;         &lt;Unit&gt;YEAR&lt;/Unit&gt;         &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;       &lt;/Term&gt;     &lt;/RstFrqcy&gt;   &lt;/Fltg&gt; &lt;/ScndLeg&gt; &lt;/IntrstRate&gt; </pre> |
| 82                                                                                                  | Multiplikatur tal-perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1 | 6                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 99                                                                                                  | Identifikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                  | EU0009652783                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 100                                                                                                 | Indikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                      | EURI                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 101                                                                                                 | Isem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                           | Rata Interbankarja Offruta f'Euro |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 102                                                                                                 | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                 | A004                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 103                                                                                                 | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2                             | KULL XAHAR                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 104                                                                                                 | Multiplikatur tal-perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2           | 6                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 105                                                                                                 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli tal-komponent 2 – perjodu ta' żmien                      | KULL XAHAR                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 106                                                                                                 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli tal-komponent 2 – multiplikatur                          | 3                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

| Tabella 27 – Rapportar ta' swap bejn muniti differenti tar-rati tal-imgħax minn fiss għal varjabbli |                                                                              |         |             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------|---------|-------------|
| Nru                                                                                                 | Kamp                                                                         | Eżempju | Messaġġ XML |
| 107                                                                                                 | Perjodu tal-frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2       | SENA    |             |
| 108                                                                                                 | Multiplikatur tal-frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2 | 1       |             |
| 109                                                                                                 | Firxa tal-komponent 2                                                        | 0       |             |
| 110                                                                                                 | Munita tal-firxa tal-komponent 2                                             |         |             |

## 4.2 Rapportar tas-swapzjonijiet

411. Meta jirrapportaw l-iswapzjonijiet, il-kontropartijiet għandhom jipprovdu kemm il-kampijiet relatati mal-opzjonijiet (kampijiet 2.132-2.142) kif ukoll il-kampijiet li jikkaratterizzaw l-iswap sottostanti (kampijiet 2.79-2.110).
412. L-eżerċizzju tal-iswapzjoni għandu jiġi rapportat bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Eżerċizzju". L-iswap li jirriżulta għandu jiġi rapportat bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u bit-tip ta' event "Eżerċizzju" kif ukoll bil-kamp 2.3 "UTI precedenti" mimli.
413. It-tabelli ta' hawn taħt juru kif l-iswapzjoni oriġinali, l-eżerċizzju ta' dik l-iswapzjoni u l-iswap li jirriżulta għandhom jiġu rapportati.

### 4.2.1 Swapzjoni fuq swap ta' rata tal-imgħax minn fiss għal varjabbli

414. Il-kontroparti li tidhol f'opzjoni ta' bejgħ Amerikana fuq swap ta' rata tal-imgħax minn fiss għal varjabbli bbażat fuq 1D SONIA vs 0.75 % (bl-ebda firxa addizzjonali). Il-primjum huwa 200,000 GBP. Jekk eżerċitat, il-kontroparti li tirrapporta tħallas ir-rata fissa u l-kontropartijiet jiskambjaw il-pagamenti kull 3 xhur u l-frekwenza tar-risettjar tiġi stabbilita għal annwali. Il-konvenzjoni għall-għadd tal-jiem hija Attwali/Attwali ISDA.

**Tabella 28 – Rapportar ta' swapzjoni fuq swap ta' rata tal-imghax minn fiss għal varjabbli**

| Nru | Kamp                                                                                             | Eżempju                          | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | UTI                                                                                              | AAAAABBBBBBCCCCCD<br>DDDD12345   | <pre> &lt;Rpt&gt;&lt;New&gt;&lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         AAAAABBBBBBCCCCDDDD12345       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...     &lt;IntrstRate&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Fxd&gt;           &lt;Rate&gt;             &lt;Rate&gt;0.75&lt;/Rate&gt;           &lt;/Rate&gt;           &lt;DayCnt&gt;             &lt;Cd&gt;A008&lt;/Cd&gt;           &lt;/DayCnt&gt;           &lt;PmtFrqcy&gt;             &lt;Term&gt;               &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt;               &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt;             &lt;/Term&gt;           &lt;/PmtFrqcy&gt;         &lt;/Fxd&gt;       &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;ScndLeg&gt;         &lt;Fltg&gt;           &lt;Id&gt;GB00B56Z6W79&lt;/Id&gt;           &lt;Nm&gt;Sterling Overnight             Index Average&lt;/Nm&gt;           &lt;Rate&gt;             &lt;Cd&gt;SONA&lt;/Cd&gt;           &lt;/Rate&gt;           &lt;RefPrd&gt;             &lt;Unit&gt;DAIL&lt;/Unit&gt;             &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;           &lt;/RefPrd&gt;           &lt;Sprd&gt;             &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;           &lt;/Sprd&gt;           &lt;DayCnt&gt;             &lt;Cd&gt;A008&lt;/Cd&gt;           &lt;/DayCnt&gt;           &lt;PmtFrqcy&gt;             &lt;Term&gt;               &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt;               &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt; </pre> |
| 79  | Rata fissa tal-komponent 1 jew tal-kupun                                                         | 0.75                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 80  | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1                      | A008                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 81  | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1                  | KULL XAHAR                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 82  | Multiplikatur tal-perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupuntal-komponent 1 | 3                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 99  | Identifikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                 | GB00B56Z6W79                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 100 | Indikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                     | SONA                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 101 | Isem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                          | Sterling Overnight Index Average |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 102 | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                | A008                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 103 | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2                            | KULL XAHAR                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 104 | Multiplikatur tal-perjodu ta' frekwenza tal-                                                     | 3                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

**Tabella 28 – Rapportar ta' swapzjoni fuq swap ta' rata tal-imghax minn fiss għal varjabbli**

| Nru | Kamp                                                                         | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|------------------------------------------------------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                  |         | <pre> &lt;/Term&gt; &lt;/PmtFrqcy&gt; &lt;RstFrqcy&gt;   &lt;Term&gt;     &lt;Unit&gt;YEAR&lt;/Unit&gt;     &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;   &lt;/Term&gt; &lt;/RstFrqcy&gt; &lt;/Fltg&gt; &lt;/ScndLeg&gt; &lt;/IntrstRate&gt; &lt;Optn&gt;   &lt;Tp&gt;PUTO&lt;/Tp&gt;   &lt;ExrcStyle&gt;AMER&lt;/ExrcStyle&gt;   &lt;StrkPric&gt;     &lt;Pctg&gt;0.75&lt;/Pctg&gt;   &lt;/StrkPric&gt;   &lt;PrmAmt Ccy="GBP"&gt;200000.00   &lt;/PrmAmt&gt;   &lt;PrmPmtDt&gt;2022-07-01   &lt;/PrmPmtDt&gt;   &lt;MtrtyDtOfUndrlyg&gt;2025-12-01   &lt;/MtrtyDtOfUndrlyg&gt; &lt;/Optn&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt;&lt;/New&gt;&lt;/Rpt&gt; </pre> |
| 105 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli tal-komponent 2 – perjodu ta' żmien | KULJUM  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 106 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli tal-komponent 2 – multiplikatur     | 1       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 107 | Perjodu tal-frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2       | SENA    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 108 | Multiplikatur tal-frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 109 | Firxa tal-komponent 2                                                        | 0       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 110 | Munita tal-firxa tal-komponent 2                                             |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 132 | Tip ta' opzjoni                                                              | PUTO    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 133 | Stil ta' opzjoni                                                             | AMER    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 134 | Prezz eżerċitar tal-                                                         | 0.75    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 138 | Munita/par muniti tal-prezz tal-eżerċitar                                    |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 139 | Ammont primjum tal-opzjoni                                                   | 200,000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

**Tabella 28 – Rapportar ta' swapzjoni fuq swap ta' rata tal-imgħax minn fiss għal varjabbli**

| Nru | Kamp                                   | Eżempju    | Messaġġ XML |
|-----|----------------------------------------|------------|-------------|
| 140 | Munita tal-primjum opzjoni             | GBP        |             |
| 141 | Data pagament primjum opzjoni ta' tal- | 2022-07-01 |             |
| 142 | Data ta' maturità tas-sottostanti      | 2025-12-01 |             |
| 151 | Tip ta' azzjoni                        | NEWT       |             |
| 152 | Tip ta' event                          | TRAD       |             |

**Tabella 29 - Rapportar ta' eżerċizzju ta' swapzjoni**

| Nru | Kamp                            | Eżempju                    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|---------------------------------|----------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | UTI                             | AAAAABBBBBCCCCDDDD DD12345 | <pre> &lt;Rpt&gt;&lt;Termntn&gt;&lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         AAAAABBBBBCCCCDDDDDD12345       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;EarlyTermntnDt&gt;2022-11-01     &lt;/EarlyTermntnDt&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;EXER&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt;&lt;/Termntn&gt;&lt;/Rpt&gt; </pre> |
| 3   | UTI preċedenti                  |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 45  | Data tat-termin azzjoni bikrija | 2022-11-01                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 151 | Tip ta' azzjoni                 | TERM                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 152 | Tip ta' event                   | EXER                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

**Tabella 30 - Rapportar ta' swap wara l-eżerċizzju tal-iswapzjoni**

| Nru | Kamp                                                                                                                                      | Eżempju                        | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | UTI                                                                                                                                       | AAAAABBBBBBCCCCCDD<br>DDD67890 | <pre> &lt;Rpt&gt;&lt;New&gt;&lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         AAAAABBBBBBCCCCCDDDDDD67890       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;PrrTxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         AAAAABBBBBBCCCCCDDDDDD12345       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/PrrTxId&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;EXER&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...     &lt;IntrstRate&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Fxd&gt;           &lt;Rate&gt;             &lt;Rate&gt;0.75&lt;/Rate&gt;           &lt;/Rate&gt;           &lt;DayCnt&gt;             &lt;Cd&gt;A008&lt;/Cd&gt;           &lt;/DayCnt&gt;           &lt;PmtFrqcy&gt;             &lt;Term&gt;               &lt;Unit&gt;MNTH&lt;/Unit&gt;               &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt;             &lt;/Term&gt;           &lt;/PmtFrqcy&gt;         &lt;/Fxd&gt;       &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;ScndLeg&gt;         &lt;Fltg&gt;           &lt;Id&gt;GB00B56Z6W79&lt;/Id&gt;           &lt;Nm&gt;Sterling Overnight             Index Average&lt;/Nm&gt;           &lt;Rate&gt;             &lt;Cd&gt;SONA&lt;/Cd&gt;           &lt;/Rate&gt;           &lt;RefPrd&gt;             &lt;Unit&gt;DAIL&lt;/Unit&gt;             &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;           &lt;/RefPrd&gt;           &lt;Sprd&gt;             &lt;Pctg&gt;0&lt;/Pctg&gt;           &lt;/Sprd&gt;           &lt;DayCnt&gt;             &lt;Cd&gt;A008&lt;/Cd&gt;           &lt;/DayCnt&gt;           &lt;PmtFrqcy&gt; </pre> |
| 3   | UTI<br>preċeden<br>ti                                                                                                                     | AAAAABBBBBBCCCCCDD<br>DDD12345 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 79  | Rata<br>fissa tal-<br>kompone<br>nt 1 jew<br>tal-kupun                                                                                    | 0.75                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 80  | Konvenzj<br>oni tal-<br>għadd<br>tal-jiem<br>tar-rata<br>fissa jew<br>tal-kupun<br>tal-<br>kompone<br>nt 1                                | A008                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 81  | Perjodu<br>ta' frekwenz<br>a tal-<br>pagamen<br>t tar-rata<br>fissa jew<br>tal-kupun<br>tal-<br>kompone<br>nt 1                           | KULL XAHAR                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 82  | Multiplika<br>tur tal-<br>perjodu<br>ta' frekwenz<br>a tal-<br>pagamen<br>t tar-rata<br>fissa jew<br>tal-kupun<br>tal-<br>kompone<br>nt 1 | 3                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 99  | Identifikat<br>ur tar-<br>rata<br>varjabbli<br>tal-                                                                                       | GB00B56Z6W79                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

**Tabella 30 - Rapportar ta' swap wara l-eżerċizzju tal-iswapzjoni**

| Nru | Kamp                                                                                    | Eżempju                          | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | komponent 2                                                                             |                                  | <pre> &lt;Term&gt;   &lt;Unit&gt;Mnth&lt;/Unit&gt;   &lt;Val&gt;3&lt;/Val&gt; &lt;/Term&gt; &lt;/PmtFrqcy&gt; &lt;RstFrqcy&gt;   &lt;Term&gt;     &lt;Unit&gt;YEAR&lt;/Unit&gt;     &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;   &lt;/Term&gt;   &lt;/RstFrqcy&gt; &lt;/Fltg&gt; &lt;/ScndLeg&gt; &lt;/IntrstRate&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt;&lt;/New&gt;&lt;/Rpt&gt; </pre> |
| 100 | Indikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                            | SONA                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 101 | Isem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                                                 | Sterling Overnight Index Average |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 102 | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata varjabbli tal-komponent 2                       | A008                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 103 | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2                   | KULL XAHAR                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 104 | Multiplikatur tal-perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata varjabbli tal-komponent 2 | 3                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 105 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli                                                | KULJUM                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

**Tabella 30 - Rapportar ta' swap wara l-eżerċizzju tal-iswapzjoni**

| Nru | Kamp                                                                         | Eżempju | Messaġġ XML |
|-----|------------------------------------------------------------------------------|---------|-------------|
|     | tal-komponent 2 – perjodu ta' żmien                                          |         |             |
| 106 | Perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli tal-komponent 2 – multiplikatur     | 1       |             |
| 107 | Perjodu ta' frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2       | SENA    |             |
| 108 | Multiplikatur tal-frekwenza tar-risettjar tar-rata varjabbli tal-komponent 2 | 1       |             |
| 109 | Firxa tal-komponent 2                                                        | 0       |             |
| 110 | Munita tal-firxa tal-komponent 2                                             |         |             |
| 151 | Tip ta' azzjoni                                                              | NEWT    |             |
| 152 | Tip ta' event                                                                | EXER    |             |

### 4.3 Rapportar ta' prodotti IR oħra

415. Il-Ftehimiet tar-Rata Forward (FRAs), l-iswaps bejn il-muniti, il-limiti massimi u l-limiti minimi għandhom jiġu kklassifikati bħala derivattivi tal-interess.
416. Meta jirrapportaw l-FRAs, il-kontropartijiet għandhom joqogħdu attenti għal li ġej:
- Ir-rata sottostanti għandha tiġi rapportata fil-kampijiet relatati mat-taqsima sottostanti (kampijiet 2.1302.16).
  - Il-kronogramma tal-eżekuzzjoni għandha timtela bid-data u bil-ħin rilevanti ta' meta d-derivattiv ġie konkluż mill-kontropartijiet u skont l-ispeċifikazzjonijiet fir-regoli ta' validazzjoni.
  - Id-data effettiva hija d-data ta' meta l-obbligi skont il-kuntratt jidhlu fis-seħħ. Sakemm l-obbligi bejn il-kontropartijiet ma jiġux posposti għal data futura, dan huwa l-istess bħall-parti tad-data tal-kronogramma tal-eżekuzzjoni. Id-data tal-eżekuzzjoni mhijiex id-data tas-saldu msemmija fid-dokumentazzjoni tal-FRA.
  - Id-data ta' maturità hija d-data maqbula bejn il-kontropartijiet meta jiskadu l-obbligi skont id-derivattiv. Fil-każ tal-FRAs, din hija d-data li fiha l-iskoperturi bejn il-kontropartijiet tneħħew permezz tad-determinazzjoni tal-pagament li jkopri d-differenza bejn ir-rata miftiehma u r-rata tas-suq prevalenti. Din mhijiex id-data finali tar-rata sottostanti.
  - Id-data tas-saldu hija d-data li fiha l-kontropartijiet jissaldaw is-sottostanti. Is-sottostanti ta' FRA huwa rata tal-imghax forward u s-saldu tad-differenza bejn ir-rata miftiehma u r-rata tas-suq prevalenti li jew tikkonċidi mad-data ta' maturità jew isseħħ f'data iktar tard.
417. Eżempju ta' FRA (rappreżentat bl-użu tat-terminoloġija tal-industrija):
- Eżegwit fit-22 ta' Frar
  - Data tal-Iffissar (iffissar ta' jumejn) 20 ta' Mejju
  - Data Effettiva (3M) 22 ta' Mejju
  - Data ta' Maturità (6M) 22 ta' Awwissu
  - Data tas-Saldu 22 ta' Mejju
418. Fl-eżempju ta' hawn fuq, għal skopijiet ta' rapportar, id-data effettiva hi t-22 ta' Frar - sakemm il-kontropartijiet ma jiftiehmux li jipposponu d-data li fiha l-obbligi jidhlu fis-seħħ - u d-data ta' maturità hija l-20 ta' Mejju.
419. Fil-każ tal-limiti massimi u minimi, il-kontropartijiet għandhom jimlew kemm il-kampijiet rilevanti għall-opzjonijiet kif ukoll il-kampijiet rilevanti għad-derivattivi tar-rati tal-imghax (b'mod simili għall-eżempju tal-iswapzjoni mogħti fit-taqsima 4.2).
420. Fil-każ ta' swaps bejn il-muniti, il-kontropartijiet għandhom jimlew kemm il-kampijiet rilevanti għad-derivattivi tal-kambju kif ukoll il-kampijiet rilevanti għad-derivattivi tar-rati tal-imghax.

## 4.4 Rapportar tal-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju u tal-kuntratti forward tal-kambju

421. Id-data finali tas-saldu kuntrattwali kif speċifikata fl-RTS dwar ir-rapportar mhijiex kamp ripetibbli, u għalhekk mhuwiex possibbli li jiġu rapportati ż-żewġ dati tas-saldu – tal-komponent inizjali u finali – f’dan il-kamp.
422. Swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju jiġi rapportat f’rapport uniku; għalhekk l-identifikatur tal-pakkett m’għandux jimtela.
423. L-eżempji ta’ hawn taħt juru kif swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju u avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja li jaffettwaw komponent uniku ta’ swap għandhom jiġu rapportati skont l-Artikolu 9 tal-EMIR.

### 4.4.1 Swaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju (spot-forward u forward-forward)

424. Ix-xenarji li ġejjin huma kkunsidrati:
- f. Xenarju A: Rapportar ta’ swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmula minn komponent spot u forward.
  - g. Xenarju B: Rapportar ta’ swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmula minn żewġ komponenti forward.
425. Fiż-żewġ xenarji, id-derivattivi għandhom il-karatteristiċi li ġejjin:
- Il-banek A u B jidhlu fi strument swap EUR/GBP fl-1 ta’ Ġunju 2018 (irrispettivament minn kif l-istrument ġie sussegwentement konfermat jew saldat);
  - nozzjonali tal-kuntratt: EUR 1,000,000;
  - data ta’ maturità tal-kuntratt: 31 ta’ Diċembru 2018;
  - l-iswap huwa saldat b’mod fiżiku;
  - Bank A jagħti GBP u jirċievi EUR għall-komponent finali; għalhekk jiġi identifikat bħala r-riċevitur tal-komponent 1 (jiġifieri jirċievi l-munita rapportata fil-kamp “Munita nozzjonali 1”, EUR);
  - ir-rata tal-kambju tal-komponent inizjali hija 0.88 EUR/GBP, filwaqt li r-rata tal-kambju tal-komponent finali hija 0.865 EUR/GBP.

**Tabella 31 - Rapportar ta’ swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn komponent spot u forward**

| Punt | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                             |
|------|--------------------------------------------|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1    | Kronogramma tar-rapportar                  | 2018-06-01T00:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lg1&gt; </pre> |
| 4    | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                         |

**Tabella 31 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn komponent spot u forward**

| Punt | Kamp                       | Eżempju            | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------|----------------------------|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 9    | Kontroparti 2              | ABCDEFGHIJKLMNQRST | <pre> &lt;LEI&gt;12345678901234500000 &lt;/LEI&gt; &lt;/Lgl&gt; &lt;/Id&gt; ... &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;   &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;TAKE &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;   &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;MAKE &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt; &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lgl&gt;       &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST     &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lgl&gt;   &lt;/IdTp&gt;   ... &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;2018-06-01T12:00:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;SFAXXP     &lt;/PdctClssfctn&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;123456     &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;ScndLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;865000&lt;/Amt&gt;       &lt;/ScndLeg&gt;     &lt;/NtnlAmt&gt;     ...     &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06- 01T12:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;FctvDy&gt;2018-06-01&lt;/FctvDy&gt; </pre> |
| 18   | Direzzjoni tal-komponent 1 | TAKE               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 19   | Direzzjoni tal-komponent 2 | MAKE               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 1    | UTI                        | 123456             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

**Tabella 31 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn komponent spot u forward**

| Punt | Kamp                          | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------|-------------------------------|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |                               |                      | <pre> &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31&lt;/XprtnDt&gt; &lt;SttlnDt&gt;2018-12-31&lt;/SttlnDt&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;Ccy&gt;   &lt;XchgRate&gt;0.88&lt;/XchgRate&gt;   &lt;FwdXchgRate&gt;0.865   &lt;/FwdXchgRate&gt;   &lt;XchgRateBsis&gt;     &lt;CcyPair&gt;       &lt;BaseCcy&gt;EUR&lt;/BaseCcy&gt;       &lt;QtdCcy&gt;GBP&lt;/QtdCcy&gt;     &lt;/CcyPair&gt;   &lt;/XchgRateBsis&gt; &lt;/Ccy&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 6    | Identifikatur tal-pakkett     |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 9    | Klassifikazzjo ni tal-prodott | SFAXXP               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 10   | Tip ta' kuntratt              | SWAP                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 11   | Klassi tal-assi               | CURR                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 19   | Munita tas-saldu 1            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 20   | Munita tas-saldu 2            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 42   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni   | 2018-06-01T12:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

**Tabella 31 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn komponent spot u forward**

| Punt | Kamp                               | Eżempju    | Messaġġ XML |
|------|------------------------------------|------------|-------------|
| 43   | Data effettiva                     | 2018-06-01 |             |
| 44   | Data ta' skadenza                  | 2018-12-31 |             |
| 46   | Data finali tas-saldu kuntrattwali | 2018-12-31 |             |
| 47   | Tip ta' konsenja                   | PHYS       |             |
| 48   | Prezz                              |            |             |
| 49   | Munita tal-prezz                   |            |             |
| 55   | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  | 1,000,000  |             |
| 64   | Ammont nozzjonali tal-komponent 2  | 865,000    |             |
| 56   | Munita nozzjonali 1                | EUR        |             |
| 65   | Munita nozzjonali 2                | GBP        |             |
| 113  | Rata tal-kambju 1                  | 0.88       |             |

**Tabella 31 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn komponent spot u forward**

| Punt | Kamp                     | Eżempju | Messaġġ XML |
|------|--------------------------|---------|-------------|
| 114  | Rata tal-kambju forward  | 0.865   |             |
| 115  | Bażi tar-rata tal-kambju | EUR/GBP |             |
| 151  | Tip ta' azzjoni          | NEWT    |             |
| 152  | Tip ta' event            | TRAD    |             |

**Tabella 32 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn żewġ komponenti forward**

| Punt | Kamp                      | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------|---------------------------|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1    | Kronogramma tar-rapportar | 2018-06-01T00:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lg1&gt;             &lt;LEI&gt;12345678901234500000           &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lg1&gt;         &lt;/Id&gt;       ...       &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;         &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;TAKE       &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;         &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;MAKE       &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt;       &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lg1&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST         &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lg1&gt;       &lt;/IdTp&gt;       ...     &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;/CtrPty&gt;   &lt;RptgTmStmp&gt;2018-06-01T12:00:00Z   &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; </pre> |

**Tabella 32 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn żewġ komponenti forward**

| Punt | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------|------|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |      |         | <pre> &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;SFCXXP     &lt;/PdctClssfctn&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         123457       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           1000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;ScndLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;           865000&lt;/Amt&gt;         &lt;/ScndLeg&gt;       &lt;/NtnlAmt&gt;     ...     &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06-01T       12:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;FctvDy&gt;2018-06-01&lt;/FctvDy&gt;     &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31&lt;/XprtnDt&gt;     &lt;SttlmDt&gt;2018-12-31&lt;/SttlmDt&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...     &lt;Ccy&gt;       &lt;XchgRate&gt;0.88&lt;/XchgRate&gt;       &lt;FwdXchgRate&gt;0.865       &lt;/FwdXchgRate&gt;       &lt;XchgRateBsis&gt;         &lt;CcyPair&gt;           &lt;BaseCcy&gt;EUR&lt;/BaseCcy&gt;           &lt;QtdCcy&gt;GBP&lt;/QtdCcy&gt;         &lt;/CcyPair&gt;       &lt;/XchgRateBsis&gt;     &lt;/Ccy&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/New&gt; </pre> |

**Tabella 32 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn żewġ komponenti forward**

| Punt | Kamp                                          | Eżempju                  | Messaġġ XML |
|------|-----------------------------------------------|--------------------------|-------------|
| 4    | Kontroparti 1<br>(Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000     |             |
| 9    | Kontroparti 2                                 | ABCDEFGHIJKLMNPOQ<br>RST |             |
| 18   | Direzzjoni tal-komponent 1                    | TAKE                     |             |
| 19   | Direzzjoni tal-komponent 2                    | MAKE                     |             |
| 1    | UTI                                           | 123457                   |             |
| 6    | Identifikatur tal-pakkett                     |                          |             |
| 9    | Klassifikazzjoni tal-prodott                  | SFCXXP                   |             |
| 10   | Tip ta' kuntratt                              | SWAP                     |             |
| 11   | Klassi tal-assi                               | CURR                     |             |
| 19   | Munita tas-saldu 1                            |                          |             |
| 20   | Munita tas-saldu 2                            |                          |             |
| 42   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                   | 2018-06- 01T12:00:00Z    |             |
| 43   | Data effettiva                                | 2018-06-01               |             |
| 44   | Data ta' skadenza                             | 2018-12-31               |             |

**Tabella 32 - Rapportar ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju magħmul minn żewġ komponenti forward**

| Punt | Kamp                               | Eżempju    | Messaġġ XML |
|------|------------------------------------|------------|-------------|
| 46   | Data finali tas-saldu kuntrattwali | 2018-12-31 |             |
| 47   | Tip ta' konsenja                   | PHYS       |             |
| 48   | Prezz                              |            |             |
| 49   | Munita tal-prezz                   |            |             |
| 55   | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  | 1,000,000  |             |
| 64   | Ammont nozzjonali tal-komponent 2  | 865,000    |             |
| 56   | Munita nozzjonali 1                | EUR        |             |
| 65   | Munita nozzjonali 2                | GBP        |             |
| 113  | Rata tal-kambju 1                  | 0.88       |             |
| 114  | Rata tal-kambju forward            | 0.865      |             |
| 115  | Baži tar-rata tal-kambju           | EUR/GBP    |             |
| 151  | Tip ta' azzjoni                    | NEWT       |             |
| 152  | Tip ta' event                      | TRAD       |             |

#### 4.4.2 Kompjessjoni tal-komponent inizjali tal-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju

426. Ix-xenarju li ġej huwa kkunsidrat:

- Id-derivattiv huwa konkluż fl-1 ta' Ġunju 2018;

- nozzjonali tal-kuntratt: EUR 1,000,000;
- data ta' maturità tal-kuntratt: 31 ta' Diċembru 2018;
- l-iswap huwa saldat b'mod fiżiku;
- Il-bank A jbigħ EUR u jieħu GBP għall-komponent inizjali (u jagħti GBP u jirċievi EUR għall-komponent finali);
- ir-rata ta' kambju tal-komponent inizjali hija 0.88 EUR/GBP, filwaqt li r-rata ta' kambju tal-komponent finali hija 0.865 EUR/GBP;
- iż-żewġ dati ta' saldu huma 01/08/2018 u 31/12/2018.

427. Fis-17 ta' Lulju, hemm kompressjoni tal-komponent inizjali, filwaqt li l-komponent finali jkompli. Għalhekk, l-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju għandu jiġi terminat bit-tip ta' azzjoni "TERM" u bit-tip ta' event "COMP" u kuntratt forward tas-suq tal-muniti barranin li jirriżulta minn din il-kompressjoni għandu jiġi rapportat b'UTI ġdid u l-kamp "PTRR" għandu jiġi mmarkat bħala veru. L-"ID tal-PTRR" jiġi pprovdut mill-fornitur tas-servizz PTRR WWWWWXXXXXXYYYYZZZZZ u jimtela kemm għall-kuntratt forward tal-kambju kif ukoll għar-rapport tat-terminazzjoni tal-iswap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju.

428. Dan il-mod ta' rapportar huwa maħsub biss fil-każijiet meta l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja jaffettwaw komponent uniku ta' swap tal-valuti skont ir-rata tal-kambju. M'għandux jiġi segwit fil-każ ta' saldu normali ta' komponent inizjali, kif maħsub fil-kuntratt oriġinali.

429. F'konformità mar-regoli ta' validazzjoni, subsett limitat ta' kampijiet biss huwa meħtieġ għat-tip ta' azzjoni "TERM".

| Tabella 33 - Rapport Ġdid (għal swap) |                           |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------------------------------------|---------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                   | Kamp                      | Eżempju               | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 1                                     | Kronogramma tar-rapportar | 2018-06- 01T12:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234500000 &lt;/LEI&gt;            &lt;/Lgl&gt;         &lt;/Id&gt;         ...       &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;  &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;TAKE &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;  &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;MAKE &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt; </pre> |

| Tabella 33 - Rapport Ġdid (għal swap) |      |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------------------------------------|------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                   | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|                                       |      |         | <pre> &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lg1&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lg1&gt;   &lt;/IdTp&gt;   ... &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;2018-06-01T 12:00:00Z&lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;  &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;   &lt;PdctClssfctn&gt;SFCXXP   &lt;/PdctClssfctn&gt; &lt;/CtrctData&gt; &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       123456     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   ...   &lt;NtnlAmt&gt;     &lt;FrstLeg&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;         1000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/FrstLeg&gt;     &lt;ScndLeg&gt;       &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;         865000&lt;/Amt&gt;       &lt;/ScndLeg&gt;     &lt;/NtnlAmt&gt;     ...     &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06-01T     12:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;FctvDy&gt;2018-06- 01&lt;/FctvDy&gt;     &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31     &lt;/XprtnDt&gt;     &lt;SttlmDt&gt;2018-12-31     &lt;/SttlmDt&gt;     ... </pre> |

**Tabella 33 - Rapport Ġdid (għal swap)**

| Nru | Kamp                                          | Eżempju                | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|-----------------------------------------------|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                               |                        | <pre> &lt;PstTradRskRdctnFlg&gt;FALSE &lt;/PstTradRskRdctnFlg&gt;  ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt;  ... &lt;Ccy&gt;  &lt;XchgRate&gt;0.88&lt;/XchgRate&gt;   &lt;FwdXchgRate&gt;0.865   &lt;/FwdXchgRate&gt;   &lt;XchgRateBsis&gt;     &lt;CcyPair&gt;  &lt;BaseCcy&gt;EUR&lt;/BaseCcy&gt;  &lt;QtdCcy&gt;GBP&lt;/QtdCcy&gt;   &lt;/CcyPair&gt;   &lt;/XchgRateBsis&gt;   &lt;/Ccy&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 4   | Kontroparti 1<br>(Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 9   | Kontroparti 2                                 | ABCDEFGHIJKLMNOPS<br>T |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 18  | Direzzjoni tal-komponent 1                    | TAKE-                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 19  | Direzzjoni tal-komponent 2                    | MAKE                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 1   | UTI                                           | 123456                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 5   | ID tal-PTRR                                   |                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 9   | Product classification                        | SFCXXP                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

**Tabella 33 - Rapport Ġdid (għal swap)**

| Nru | Kamp                               | Eżempju               | Messaġġ XML |
|-----|------------------------------------|-----------------------|-------------|
| 10  | Tip ta' kuntratt                   | SWAP                  |             |
| 11  | Asset class                        | CURR                  |             |
| 19  | Munita tas-saldu 1                 |                       |             |
| 20  | Munita tas-saldu 2                 |                       |             |
| 38  | PTRR                               | FALZ                  |             |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni        | 2018-06- 01T12:00:00Z |             |
| 43  | Data effettiva                     | 2018-06-01            |             |
| 44  | Data ta' skadenza                  | 2018-12-31            |             |
| 45  | Data tat-terminazzjoni bikrija     |                       |             |
| 46  | Data finali tas-saldu kuntrattwali | 2018-12-31            |             |
| 47  | Tip ta' konsenja                   | PHYS                  |             |
| 48  | Prezz                              |                       |             |
| 49  | Munita tal-prezz                   |                       |             |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  | 1,000,000             |             |

**Tabella 33 - Rapport Ġdid (għal swap)**

| Nru | Kamp                              | Eżempju | Messaġġ XML |
|-----|-----------------------------------|---------|-------------|
| 64  | Ammont nozzjonali tal-komponent 2 | 865,000 |             |
| 56  | Munita nozzjonali 1               | EUR     |             |
| 65  | Munita nozzjonali 2               | GBP     |             |
| 113 | Rata tal-kambju 1                 | 0.88    |             |
| 114 | Rata tal-kambju forward           | 0.865   |             |
| 115 | Baži tar-rata tal-kambju          | EUR/GBP |             |
| 151 | Tip ta' azzjoni                   | NEWT    |             |
| 152 | Tip ta' event                     | TRAD    |             |
| 154 | Livell                            | TCTN    |             |

**Tabella 34 – Terminazzjoni (minħabba kompressjoni) tal-komponent 1**

| Nru | Kamp                                       | Eżempju               | Eżempju ta' XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----|--------------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Kronogramma tar-rapportar                  | 2018-07- 17T12:00:00Z | <pre> &lt;Termntn&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lg1&gt;             &lt;LEI&gt;12345678901234500000           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lg1&gt;       &lt;/Id&gt;     ...   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;     &lt;IdTp&gt;       &lt;Lg1&gt; </pre> |
| 4   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 9   | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHJKLMNOPQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 18  | Direzzjoni tal-komponent 1                 | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 19  | Direzzjoni tal-komponent 2                 | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

**Tabella 34 – Terminazzjoni (minħabba kompressjoni) tal-komponent 1**

| Nru | Kamp                               | Eżempju                    | Eżempju ta' XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----|------------------------------------|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | UTI                                | 123456                     | <pre> &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIIJKLMNOPQRST &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lg1&gt;     &lt;/IdTp&gt;     ...     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;/CtrPty&gt;     &lt;RptgTmStmp&gt;2018-07- 17T12:00:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt;     &lt;/CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CmonTradData&gt;     &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;     123456     &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;EarlyTermntnDt&gt;2018-07-17 &lt;/EarlyTermntnDt&gt;     &lt;DerivEvt&gt;     &lt;Tp&gt;COMP&lt;/Tp&gt;     &lt;Id&gt;     &lt;PstTradRskRdctnIdr&gt;     &lt;Strr&gt;WWWXXXXX YYYYYZZZZ&lt;/Strr&gt;     &lt;Id&gt;1234567&lt;/Id&gt;     &lt;/PstTradRskRdctnIdr&gt;     &lt;/Id&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...     &lt;/TxData&gt;     &lt;/CmonTradData&gt;     &lt;Lvl&gt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/Termntn&gt; </pre> |
| 5   | ID tal-PTRR                        | WWWWWXXXXXXYYYYZZZZ1234567 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 9   | Klassifikazzjoni tal-prodott       | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 10  | Tip ta' kuntratt                   | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 11  | Klassi tal-assi                    | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 19  | Munita tas-saldu 1                 |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 20  | Munita tas-saldu 2                 |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 38  | PTRR                               |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni        | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 43  | Data effettiva                     | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 44  | Data ta' skadenza                  | -                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 45  | Data tat-terminazzjoni bikrija     | 2018-07-17                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 46  | Data finali tas-saldu kuntrattwali |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 47  | Tip ta' konsenja                   |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 48  | Prezz                              |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 49  | Munita tal-prezz                   |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

| Tabella 34 – Terminazzjoni (minħabba kompressjoni) tal-komponent 1 |                                   |         |                 |
|--------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|---------|-----------------|
| Nru                                                                | Kamp                              | Eżempju | Eżempju ta' XML |
| 64                                                                 | Ammont nozzjonali tal-komponent 2 | -       |                 |
| 56                                                                 | Munita nozzjonali 1               |         |                 |
| 65                                                                 | Munita nozzjonali 2               |         |                 |
| 113                                                                | Rata tal-kambju 1                 |         |                 |
| 114                                                                | Rata tal-kambju forward           |         |                 |
| 115                                                                | Baži tar-rata tal-kambju          |         |                 |
| 151                                                                | Tip ta' azzjoni                   | TERM    |                 |
| 152                                                                | Tip ta' event                     | COMP    |                 |
| 154                                                                | Livell                            | TCTN    |                 |

| Tabella 35 – Rapport ġdid ta' kuntratt forward tal-kambju (għall-komponent finali tal-iswap preċedenti) |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                     | Kamp                                       | Eżempju               | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 1                                                                                                       | Kronogramma tar-rapportar                  | 2018-07- 17T12:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lgl&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;         &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;           TAKE         &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;       &lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/CtrPty&gt;   &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 4                                                                                                       | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 9                                                                                                       | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 18                                                                                                      | Direzzjoni tal-komponent 1                 | TAKE                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

**Tabella 35 – Rapport ġdid ta' kuntratt forward tal-kambju (għall-komponent finali tal-iswap preċedenti)**

| Nru | Kamp                         | Eżempju                   | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|------------------------------|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 19  | Direzzjoni tal-komponent 2   | MAKE                      | <pre> &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;   MAKE &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt; &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;Lgl&gt;       &lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lgl&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;2018-07-17T 12:00:00Z&lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;FORW&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;       JFTXFP     &lt;/PdctClssfctn&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;789ABC     &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           1000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/FrstLeg&gt;         &lt;ScndLeg&gt;           &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;             865000&lt;/Amt&gt;           &lt;/ScndLeg&gt;         &lt;/NtnlAmt&gt;         ...       &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt;       &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06-01       T12:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;       &lt;FctvDy&gt;2018-07-17       &lt;/FctvDy&gt;       &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31 </pre> |
| 1   | UTI                          | 789ABC                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 5   | ID tal-PTRR                  | WWWWXXXXXXYYYYZZZZ1234567 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 9   | Klassifikazzjoni tal-prodott | JFTXFP                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 10  | Tip ta' kuntratt             | FORW                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 11  | Klassi tal-assi              | CURR                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 19  | Munita tas-saldu 1           |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 20  | Munita tas-saldu 2           |                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 38  | PTRR                         | VERU                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni  | 2018-06- 01T12:00:00Z     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

**Tabella 35 – Rapport ġdid ta' kuntratt forward tal-kambju (għall-komponent finali tal-iswap preċedenti)**

| Nru | Kamp                               | Eżempju    | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 43  | Data effettiva                     | 2018-07-17 | <pre> &lt;/XprtnDt&gt; &lt;SttlmDt&gt;2018-12-31 &lt;/SttlmDt&gt; ... &lt;PstTradRskRdctnFlg&gt; true &lt;/PstTradRskRdctnFlg&gt; ... &lt;DerivEvt&gt; &lt;Tp&gt;COMP&lt;/Tp&gt; &lt;Id&gt;   &lt;PstTradRskRdctnIdr&gt;     &lt;Strr&gt;WWWXXXXXX       YYYYYZZZZ&lt;/Strr&gt;     &lt;Id&gt;1234567&lt;/Id&gt;   &lt;/PstTradRskRdctnIdr&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;Ccy&gt; &lt;FwdXchgRate&gt;0.865 &lt;/FwdXchgRate&gt; &lt;XchgRateBsis&gt;   &lt;CcyPair&gt;     &lt;BaseCcy&gt;EUR     &lt;/BaseCcy&gt;     &lt;QtdCcy&gt;GBP     &lt;/QtdCcy&gt;   &lt;/CcyPair&gt; &lt;/XchgRateBsis&gt; &lt;/Ccy&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lvl&gt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 44  | Data ta' skadenza                  | 2018-12-31 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 45  | Data tat-terminazzjoni bikrija     |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 46  | Data finali tas-saldu kuntrattwali | 2018-12-31 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 47  | Tip ta' konsenja                   | PHYS       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 48  | Prezz                              |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 49  | Munita tal-prezz                   |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  | 1,000,000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 64  | Ammont nozzjonali tal-komponent 2  | 865,000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 56  | Munita nozzjonali 1                | EUR        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

**Tabella 35 – Rapport ġdid ta' kuntratt forward tal-kambju (għall-komponent finali tal-iswap preċedenti)**

| Nru | Kamp                     | Eżempju | Skema XML |
|-----|--------------------------|---------|-----------|
| 65  | Munita nozzjonali 2      | GBP     |           |
| 113 | Rata tal-kambju 1        |         |           |
| 114 | Rata tal-kambju forward  | 0.865   |           |
| 115 | Baži tar-rata tal-kambju | EUR/GBP |           |
| 151 | Tip ta' azzjoni          | NEWT    |           |
| 152 | Tip ta' event            | COMP    |           |
| 154 | Livell                   | TCTN    |           |

#### 4.4.3 Opzjoni FX

430. Nikkunsidraw opzjoni ta' munita bil-konfigurazzjoni li ġejja:

- Il-banek A u B jidhlu fi strument ta' opzjoni ta' xiri Ewropew EUR/GBP fil-1 ta' Ġunju 2018
- nozzjonali tal-kuntratt: EUR 1,000,000;
- data ta' maturità tal-kuntratt: 31 ta' Diċembru 2018;
- l-opzjoni hija saldata b'mod fiżiku;
- Bank A huwa x-xerrej tal-opzjoni;
- l-eżerċitar tal-opzjoni huwa 0.87;
- il-primjum tal-opzjoni huwa EUR 200,000 u jithallas fil-5 ta' Ġunju 2018.

431. L-opzjoni għandha komponent wieħed biss u d-direzzjoni għandha tiġi definita f'konformità mal-mudell tax-xerrej/bejjiegħ. Għandha tiġi determinata skont liema kontroparti tixtri jew tbigħ l-opzjoni.

| Tabella 36 – Rapportar ta' opzjoni FX ġdida |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Punt                                        | Kamp                                       | Eżempju               | Eżempju ta' XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1                                           | Kronogramma tar-rapportar                  | 2018-06- 01T12:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;LEI&gt;1234567890123450000           &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lgl&gt;         &lt;/Id&gt;         ...         &lt;DrctnOrSd&gt;           &lt;CtrPtySd&gt;BYER&lt;/CtrPtySd&gt;         &lt;/DrctnOrSd&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;IdTp&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQPQRST           &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lgl&gt;         &lt;/IdTp&gt;         ...       &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;/CtrPty&gt;     &lt;RptgTmStmp&gt;2018-06-01T12:00:00Z   &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;OPTN&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;HFTAVP   &lt;/PdctClssfctn&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;123OPT&lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           1000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;/NtnlAmt&gt;     &lt;/TxData&gt;   &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 4                                           | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 1234567890123450000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 9                                           | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 17                                          | Direzzjoni                                 | BYER                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1                                           | UTI                                        | 123OPT                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 9                                           | Klassifikazzjoni tal-prodott               | HFTAVP                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 10                                          | Tip ta' kuntratt                           | OPTN                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 11                                          | Klassi tal-assi                            | CURR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 19                                          | Munita tas-saldu 1                         |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 20                                          | Munita tas-saldu 2                         |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 42                                          | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                | 2018-06- 01T12:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 43                                          | Data effettiva                             | 2018-06-01            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 44                                          | Data ta' skadenza                          | 2018-12-31            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 46                                          | Data finali tas-saldu kuntrattwali         | 2019-01-02            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

| Tabella 36 – Rapportar ta' opzjoni FX ġdida |                                           |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------------------------|-------------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Punt                                        | Kamp                                      | Eżempju    | Eżempju ta' XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 47                                          | Tip ta' konsenja                          | PHYS       | <pre> &lt;ScndLeg&gt;   &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;     870000&lt;/Amt&gt;   &lt;/ScndLeg&gt; &lt;/NtnlAmt&gt;  ... &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt; &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06-1T12:00: 00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt; &lt;FctvDy&gt;2018-06-01&lt;/FctvDy&gt; &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31&lt;/XprtnDt&gt; &lt;SttlmDt&gt;2019-01-02&lt;/SttlmDt&gt;  ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt;  ... &lt;Ccy&gt;   &lt;XchgRateBsis&gt;     &lt;CcyPair&gt;       &lt;BaseCcy&gt;EUR&lt;/BaseCcy&gt;       &lt;QtdCcy&gt;GBP&lt;/QtdCcy&gt;     &lt;/CcyPair&gt;   &lt;/XchgRateBsis&gt; &lt;/Ccy&gt; &lt;Optn&gt;   &lt;Tp&gt;CALL&lt;/Tp&gt;   &lt;ExrcStyle&gt;EURO&lt;/ExrcStyle&gt;   &lt;StrkPric&gt;     &lt;Pctg&gt;0.87&lt;/Pctg&gt;   &lt;/StrkPric&gt;   &lt;PrmAmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;200000&lt;/Amt&gt;   &lt;/PrmAmt&gt;   &lt;PrmPmtDt&gt;2018-06-05   &lt;/PrmPmtDt&gt; &lt;/Optn&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lvl&gt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 48                                          | Prezz                                     |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 49                                          | Munita tal-prezz                          |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 55                                          | Ammont nozzjonali tal-komponent 1         | 1,000,000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 56                                          | Munita nozzjonali 1                       | EUR        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 64                                          | Ammont nozzjonali tal-komponent 2         | 870,000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 65                                          | Munita nozzjonali 2                       | GBP        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 132                                         | Tip ta' opzjoni                           | CALL       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 133                                         | Stil tal-opzjoni                          | EURO       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 134                                         | Prezz tal-eżerċitar                       | 0.87       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 138                                         | Munita/par muniti tal-prezz tal-eżerċitar | EUR/GBP    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 139                                         | Ammont tal-primjum tal-opzjoni            | 200,000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 140                                         | Munita tal-primjum tal-opzjoni            | EUR        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 141                                         | Data ta' pagament tal-primjum tal-opzjoni | 2018-06-05 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 151                                         | Tip ta' azzjoni                           | NEWT       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

| Tabella 36 – Rapportar ta' opzjoni FX ġdida |               |         |                 |
|---------------------------------------------|---------------|---------|-----------------|
| Punt                                        | Kamp          | Eżempju | Eżempju ta' XML |
| 152                                         | Tip ta' event | TRAD    |                 |
| 154                                         | Livell        | TCTN    |                 |

#### 4.4.4 Iktar kunsiderazzjonijiet dwar ir-rapportar tal-muniti

432. Ir-rapportar tad-direzzjoni tad-derivattiv u tal-muniti involuti għandu jsir mill-partijiet filwaqt li jqisu l-prenotazzjoni tagħhom stess irrISPettivament mill-prenotazzjoni tal-parti l-oħra. Konsegwentement id-direzzjoni u l-ordni tal-muniti jistgħu jvarjaw fir-rapportar. Tali differenza għandha tiġi ġestita mit-TRs fil-proċess ta' rikonċiljazzjoni tagħhom sabiex id-direzzjoni tad-derivattiv titqies abbażi tal-muniti pprovduti fir-rapportar.

### 4.5 Rapportar tal-NDFs

433. Forwards mhux konsenjabbli (NDFs) huma kuntratti forward tal-kambju saldati fi flus kontanti. Tali kuntratt forward saldat fi flus kontanti jispeċifika rata ta' kambju kontra l-munita ta' konsenja (il-munita konvertibbli), tipikament id-dollaru Amerikan, ammont nozzjonali tal-munita mhux konvertibbli u data tas-saldu. Kuntratt forward tas-suq tal-muniti barranin saldat bil-flus kontanti huwa simili għal kuntratt forward tas-suq tal-muniti barranin saldat b'mod fiżiku, iżda kuntrarju għal tal-ewwel, m'hemm l-ebda kunsinna fiżika tal-muniti deżinjati fil-maturità. Fid-data ta' maturità, ir-rata ta' kambju tas-suq spot tiġi minflok imqabbla mar-rata forward sabiex tagħti valur lill-NDF. Il-kuntratt saldat bil-flus kontanti huwa saldat fuq bażi netta, fil-munita konvertibbli bbażata fuq l-ammont nozzjonali.

#### 4.5.1 NDF

434. Nikkunsidraw forward mhux konsenjabbli (NDF) ta' munita bil-konfigurazzjoni li ġejja:

- Il-banek A u B jidhlu fi strument NDF BRL/USD fl-1 ta' Ġunju 2018
- nozzjonali tal-kuntratt: 1,000,000 BRL;
- data ta' maturità tal-kuntratt: 31 ta' Diċembru 2018;
- data ta' saldu tal-kuntratt: 2 ta' Jannar 2019;
- il-kuntratt forward jiġi saldat bil-flus kontanti minhabba n-natura mhux konsenjabbli tiegħu;
- Il-bank A jibgħat jew jirċievi d-differenza (skont s-sinjal tiegħu) f'USD bejn l-ispot u l-kuntratt forward fid-data tas-saldu;
- USD jimtela fil-Munita tas-Saldu 1;

- ir-rata tal-kambju forward hija 0.29 BRL/USD.

435. Fil-każ tal-kuntratti forward relatati mal-muniti, il-kontroparti 1 għandha tidentifika lilha nnifisha bħala l-pagatur jew ir-riċevitur għall-komponent 1 (BRL f'dan l-eżempju). Peress li f'dan l-eżempju, il-kontroparti li tirrapporta tirċievi d-differenza fil-każ ta' zieda fil-valur tal-BRL (tnaqqis fir-rata ta' kambju), hija identifikata bħala r-riċevitur tal-komponent 1.

436. Il-prezz ma jimtelix għax l-informazzjoni tal-prezz titqies li hija konkluzja fil-kamp tar-rata tal-kambju forward.

437. Peress li hemm biss munita tas-saldu waħda, għandha timtela dejjem bħala munita tas-saldu 1.

| Tabella 37 – Rapportar ta' NDF |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                            | Kamp                                       | Eżempju               | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 1                              | Kronogramma tar-rapportar                  | 2018-06- 01T12:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lg1&gt;             &lt;LEI&gt;1234567890123450000           &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lg1&gt;         &lt;/Id&gt;         ...         &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;           &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;TAKE           &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;           &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;MAKE           &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt;         &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;IdTp&gt;           &lt;Lg1&gt;             &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST           &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lg1&gt;         &lt;/IdTp&gt;         ...       &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;/CtrPty&gt;     &lt;RptgTmStmp&gt;2018-06-01T12:00:00Z     &lt;/RptgTmStmp&gt;   &lt;/CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CmonTradData&gt;     &lt;CtrctData&gt;       &lt;CtrctTp&gt;FORW&lt;/CtrctTp&gt;       &lt;AsstClss&gt;CURR&lt;/AsstClss&gt;       &lt;PdctClssfctn&gt;JFTXFC       &lt;/PdctClssfctn&gt;       &lt;SttlmCcy&gt;&lt;Ccy&gt;USD&lt;/Ccy&gt; </pre> |
| 4                              | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 1234567890123450000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 9                              | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 18                             | Direzzjoni tal-komponent 1                 | TAKE                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 19                             | Direzzjoni tal-komponent 2                 | MAKE                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 1                              | UTI                                        | 123NDF                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 9                              | Klassifikazzjoni tal-prodott               | JFTXFC                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 10                             | Tip ta' kuntratt                           | FORW                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 11                             | Klassi tal-assi                            | CURR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 19                             | Munita tas-saldu 1                         | USD                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 20                             | Munita tas-saldu 2                         | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 42                             | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                | 2018-06- 01T12:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 43                             | Data effettiva                             | 2018-06-01            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 44                             | Data ta' skadenza                          | 2018-12-31            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

| Tabella 37 – Rapportar ta' NDF |                                    |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------------------------------|------------------------------------|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                            | Kamp                               | Eżempju       | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 46                             | Data finali tas-saldu kuntrattwali | 2019-01-02    | <pre> &lt;/SttlmCcy&gt; &lt;/CtrctData&gt; &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;123NDF&lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   ...   &lt;NtnlAmt&gt;     &lt;FrstLeg&gt;       &lt;Amt Ccy="BRL"&gt;1000000&lt;/Amt&gt;     &lt;/FrstLeg&gt;     &lt;ScndLeg&gt;       &lt;Amt Ccy="USD"&gt;290000&lt;/Amt&gt;     &lt;/ScndLeg&gt;   &lt;/NtnlAmt&gt;   ...   &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt;   &lt;ExctnTmStmp&gt;2018-06-01T12:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;   &lt;FctvDy&gt;2018-06-01&lt;/FctvDy&gt;   &lt;XprtnDt&gt;2018-12-31&lt;/XprtnDt&gt;   &lt;SttlmDt&gt;2019-01-02&lt;/SttlmDt&gt;   ...   &lt;DerivEvt&gt;     &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt;   &lt;/DerivEvt&gt;   ...   &lt;Ccy&gt;     &lt;FwdXchgRate&gt;0.29   &lt;/FwdXchgRate&gt;   &lt;XchgRateBsis&gt;     &lt;CcyPair&gt;       &lt;BaseCcy&gt;BRL&lt;/BaseCcy&gt;       &lt;QtdCcy&gt;USD&lt;/QtdCcy&gt;     &lt;/CcyPair&gt;   &lt;/XchgRateBsis&gt;   &lt;/Ccy&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lvl&gt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 47                             | Tip ta' konsenja                   | FLUS KONTANTI |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 48                             | Prezz                              |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 49                             | Munita tal-prezz                   |               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 55                             | Ammont nozzjonali tal-komponent 1  | 1,000,000     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 56                             | Munita nozzjonali 1                | BRL           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 64                             | Ammont nozzjonali tal-komponent 2  | 290,000       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 65                             | Munita nozzjonali 2                | USD           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 114                            | Rata tal-kambju forward            | 0.29          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 115                            | Baži tar-rata tal-kambju           | BRL/USD       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 151                            | Tip ta' azzjoni                    | NEWT          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 152                            | Tip ta' event                      | TRAD          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 154                            | Livell                             | TCTN          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

## 4.6 Rapportar tas-CFDs

438. Il-Kuntratti għad-Differenza (CFDs) ġeneralment ma jkollhom l-ebda data ta' maturità speċifikata u fil-mument tal-konklużjoni tagħhom, id-data tat-terminazzjoni wkoll ma tkunx speċifikata. Il-kontropartijiet jistgħu, fi kwalunkwe mument, jiddeċiedu li jagħlqu l-kuntratt, b'effett immedjat. Huma jistgħu wkoll jagħlqu parzjalment peress li l-kontropartijiet jistgħu jitterminaw biss parti mill-volum f'gurnata waħda u l-parti jew il-partijiet l-oħra tal-kuntratt fi kwalunkwe gurnata oħra.

439. Kull ftuħ ta' kuntratt ġdid għandu jiġi rapportat mill-kontropartijiet lit-TR bħala entratura ġdida. Dan ifisser li kull CFD għandu jiġi rapportat bl-Identifikatur Uniku tat-Tranżazzjoni distint tiegħu u bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" jew jekk in-negozju jiġi inkluż f'pożizzjoni fl-istess ġurnata jista' jiġi rapportat bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", anki jekk jitwettaq u mbagħad jiġi nnettjat jew terminat għal raġunijiet oħra matul l-istess ġurnata.
440. Barra minn dan, is-CFDs iridu jiġu rapportati anki jekk jiġu konklużi ma' kontroparti li mhijiex soġġetta għall-obbligu tar-rapportar, bħal individwu li mhux qiegħed iwettaq attività ekonomika u li konsegwentement ma jitqiesx bħala impriża.
441. CFDs sussegwenti m'għandhomx għalfejn jiġu inklużi f'pożizzjoni, madankollu, huwa rakkommandat ferm li dan isir. Peress li dawn id-derivattivi m'għandhom l-ebda maturità, dan jimplika li mingħajr ma jiġi inkluż f'pożizzjoni kull CFD individwali minn kontroparti finanzjarja, teħtieġ li tircievi aġġornamenti tal-valwazzjoni ta' kuljum jew sakemm 1) is-CFD jiġi terminat jew 2) għal dejjem. CFDs pendenti jeħtieġu aġġornamenti tal-valwazzjoni, iżda meta jiġu inklużi f'pożizzjoni, il-valwazzjoni tista' tiġi pprovduta fil-livell tal-pożizzjoni f'konformità mat-taqsimha 3.7.
442. B'mod simili għal kwalunkwe kuntratt ieħor, il-valwazzjoni rapportata ta' CFD għandha tirrappreżenta l-valur totali tal-kuntratt, iktar milli bidla ta' kuljum fil-valwazzjoni tiegħu.
443. L-ESMA tqis is-CFDs ta' tpaċija bħala derivattivi rapportabbli li jeħtieġu Identifikatur Uniku tat-Tranżazzjoni għal kull derivattiv. Fil-każ li s-CFDs ma jiġux innettjati f'pożizzjoni, is-CFDs ta' tpaċija għandhom jiġu terminati.
444. Ladarba s-CFD jingħalaq, il-kontroparti għandha tibgħat rapport ta' terminazzjoni lill-entratura inizjali, billi timla l-kamp "Data tat-terminazzjoni bikrija". Jekk is-CFD jingħalaq parzjalment, il-kontropartijiet għandhom jibagħtu rapport bit-tip ta' azzjoni "Modifika" u bit-tip ta' event "Terminazzjoni bikrija" lill-entratura inizjali, billi jnaqqsu biss l-ammont nozzjonali tiegħu (il-volum li jifdal huwa daqs il-volum li għadu ma ġiex terminat). Jekk ikun hemm għeluq parzjali ieħor, jintbagħat rapport ta' modifika ieħor – sakemm il-kuntratt finalment jingħalaq kollu. Imbagħad, il-kontropartijiet jibagħtu rapport ta' terminazzjoni bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Terminazzjoni bikrija", billi jimtela l-kamp "Data tat-terminazzjoni bikrija". F'dawn il-każijiet, il-prezz ta' ftuħ tal-kuntratt jiġi rapportat biss fl-ewwel rapport (bit-tip ta' azzjoni "Ġdid") u ma jiġix aġġornat fir-rapporti ta' modifika li jiġu wara. Jekk jogħġbok innota li l-possibbiltà li jiġi modifikat in-nozzjonali ta' negozju partikolari, kif għadu kif ġie deskritt, għandha tintuża biss fil-każ li ż-żewġ partijiet fil-fatt jaqblu li jitterminaw parzjalment dak in-negozju. Jekk madankollu jaqblu li jikkonkludu negozju ta' tpaċija b'nozzjonal iżgħar, mela jkun meħtieġ rapport bit-tip ta' azzjoni "Ġdid".

#### 4.6.1 CFD

445. It-tabella ta' hawn taħt turi l-mili tal-kampijiet għal CFD ġdid (li mhux inkluż f'pożizzjoni) fuq azzjoni XS1234567890. Il-UIP assenjat lil dak il-prodott CFD huwa

AAA111222333. Il-prezz inizjali tal-azzjoni huwa EUR 30 u l-kontroparti li tirrapporta A tixtri CFD fuq 1,000 azzjoni.

| Tabella 38 - Rapportar ta' CFD ġdid |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                 | Kamp                                       | Eżempju               | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 1                                   | Kronogramma tar-rapportar                  | 2023-06- 06T12:00:00Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lg1&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234500000 &lt;/LEI&gt;           &lt;/Lg1&gt;         &lt;/Id&gt;         ...       &lt;DrctnOrSd&gt;  &lt;CtrPtySd&gt;BYER&lt;/CtrPtySd&gt; &lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lg1&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lg1&gt;       &lt;/IdTp&gt;       ...     &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;/CtrPty&gt;   &lt;RptgTmStmp&gt;2023-06-06T12:00:00Z&lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;CFDS&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;EQUI&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;JESXCC     &lt;/PdctClssfctn&gt;     &lt;PdctId&gt;&lt;UnqPdctIdr&gt;&lt;Id&gt;       AAA111222333  &lt;/Id&gt;&lt;/UnqPdctIdr&gt;&lt;/PdctId&gt;     &lt;UndrlygInstrm&gt;&lt;ISIN&gt;       XS1234567890     &lt;/ISIN&gt;&lt;/UndrlygInstrm&gt;     &lt;SttlmCcy&gt;&lt;Ccy&gt;EUR&lt;/Ccy&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;  &lt;UnqTxIdr&gt;123CFD&lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt; </pre> |
| 4                                   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 9                                   | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 17                                  | Direzzjoni                                 | BYER                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 1                                   | UTI                                        | 123CFD                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 8                                   | UPI                                        | AAA111222333          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 9                                   | Klassifikazzjoni tal-prodott               | JESXCC                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 10                                  | Tip ta' kuntratt                           | CFDS                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 11                                  | Klassi tal-assi                            | EQUI                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 13                                  | Tip ta' identifikazzjoni tas-sottostanti   | I                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 14                                  | Identifikazzjoni tas-sottostanti           | XS1234567890          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 19                                  | Munita tas-saldu 1                         | EUR                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 20                                  | Munita tas-saldu 2                         | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 42                                  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                | 2023-06- 05T11:43:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 43                                  | Data effettiva                             | 2023-06-05            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 44                                  | Data ta' skadenza                          | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 46                                  | Data finali tas-saldu kuntrattwali         | -                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 47                                  | Tip ta' konsenja                           | FLUS KONTANTI         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

| Tabella 38 - Rapportar ta' CFD ġdid |                                            |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------------------------------|--------------------------------------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                 | Kamp                                       | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 48                                  | Prezz                                      | 30      | <pre> ... &lt;TxPric&gt;   &lt;Pric&gt;     &lt;MntryVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;30&lt;/Amt&gt;     &lt;/MntryVal&gt;   &lt;/Pric&gt; &lt;/TxPric&gt; ... </pre>                                                                                                                                          |
| 49                                  | Munita tal-prezz                           | EUR     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 55                                  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1          | 30,000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 56                                  | Munita nozzjonali 1                        | EUR     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 60                                  | Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 1 | 1,000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 151                                 | Tip ta' azzjoni                            | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 152                                 | Tip ta' event                              | TRAD    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 154                                 | Livell                                     | TCTN    | <pre> ... &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; &lt;ExctnTmStmp&gt;2023-06-05 T11:43:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt; &lt;FctvDy&gt;2023-06- 05&lt;/FctvDy&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |

## 4.7 Rapportar tad-derivattivi ta' ekwità

446. Id-derivattivi ta' ekwità huma tip ta' derivattivi li l-valur tagħhom huwa derivat, almenu parzjalment, minn titolu ta' ekwità sottostanti wieħed jew iktar. L-opzjonijiet u l-futuri huma d-derivattivi ta' ekwità l-iktar komuni. It-tip ta' kuntratt għandu jiġi speċifikat fil-kamp 2.10 u l-klassi tal-assi (EQUI) għandha tiġi speċifikata fil-kamp 2.11 kif indikat fl-RTS u fl-ITS dwar ir-rapportar.

447. Swap tar-Redditi Totali huwa kuntratt bejn żewġ partijiet li jiskambjaw ir-redditi minn assi finanzjarju (sottostanti) bejniethom. F'dan it-tip ta' derivattivi, parti waħda tagħmel pagamenti abbażi ta' rata stabbilita filwaqt li l-parti l-oħra tagħmel

pagamenti abbażi tar-redditu totali tal-assi sottostanti. L-assi sottostanti huma normalment bond, ekwità, indici tal-ekwità, imġax, jew self.

448. Pereżempju, Swap tar-Redditu Totali fuq indici tal-ekwità għandu jiġi rapportat bil-valur “EQUI” fil-kamp 2.11 “Klassi tal-Assi”, filwaqt li Swap tar-Redditu Totali fuq bond jew self għandu jiġi rapportat bil-valur “CRDT” fil-kamp 2.11 “Klassi tal-Assi”.
449. It-tip ta’ event “Event Korporattiv” għandu jintuża fil-każ tal-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja skattati mill-azzjonijiet korporattivi fuq l-ekwitàjiet sottostanti. Ara t-taqsima 3.6 għal iktar dettalji.
450. Id-direzzjoni tan-negozju tal-biċċa l-kbira tal-iswaps ta’ ekwità għandha tkun rapportata wara l-approċċ li fih il-kontropartijiet jindikaw jekk il-kontroparti li tirrapporta hijiex pagatur/riċevitur għal komponent partikolari fil-ħin tad-derivattiv, billi jintuża indikatur fil-kampijiet dedikati (“Direzzjoni tal-komponent 1” jew “Direzzjoni tal-komponent 2”). Ara t-taqsima 3.12 ta’ dawn il-Linji Gwida għal iktar dettalji.
451. Barra minn hekk, kif iddikjarat fl-Artikolu 4 tal-ITS dwar ir-rapportar, fl-iswaps relatati mad-dividendi, il-kontroparti li tirċievi l-ekwivalenti tal-pagamenti tal-ammont tad-dividend għandha tiġi identifikata bħala x-xerrej u l-kontroparti li qed tħallas dak l-ekwivalenti tal-pagamenti tal-ammont tad-dividend għandha tiġi identifikata bħala l-bejjiegħ. Barra minn dan, għall-iswaps relatati mat-titoli minbarra l-iswaps tad-dividendi, il-kontroparti 1 għandha tidentifika lilha nnifisha bħala l-pagatur jew ir-riċevitur għall-komponent 1, u l-oppost għall-komponent 2. Il-kontroparti 2 għandha timla dawn iż-żewġ kampijiet bil-valuri opposti relatati mal-kontroparti 1.
452. Iktar dettalji dwar ir-rapportar tan-nozzjonali u tal-prezzijiet huma pprovduti fit-taqsima 3.17 ta’ dawn il-Linji Gwida.
453. Il-prezz tal-eżerċitar tal-opzjonijiet ta’ ekwità, meta l-prezz tal-eżerċitar ikun espress bħala ammont monetarju, għandu jiġi rapportat bi kwalunkwe valur sa massimu ta’ 18-il karattru numeriku inkluż sa massimu ta’ 13-il pożizzjoni deċimali; eż.: 6.39 USD espressi bħala 6.39. Jekk il-valur ikollu iktar minn 13-il numru wara l-punt deċimali, il-kontropartijiet li jirrapportaw għandhom idawru min-nofs ’il fuq (kamp 2.134 fl-RTS/ITS dwar ir-rapportar).
454. Il-prezz tal-eżerċitar tal-opzjonijiet ta’ ekwità għandu jiġi rapportat fil-munita li fiha l-prezz tal-eżerċitar huwa denominat (kampijiet 2.137 u 2.138 fl-RTS/ITS dwar ir-rapportar).

#### 4.7.1 Swap tad-dividendi

455. Istituzzjoni ta’ kreditu tikkonkludi u tirrapporta derivattiv ta’ swap ta’ ekwità fuq stokk uniku meta l-iskattatur tar-redditu jew tal-ħlas lura jkun id-dividend. L-entità tirrapporta wkoll aġġornament tal-kollateral u tal-valwazzjoni, skont il-mudell intern tagħha. Il-kontroparti l-oħra hija ditta tal-investment tal-grupp tagħha. L-ammont nozzjonali huwa EUR 1 miljun, it-tranzazzjoni hija kompletament kollateralizzata.

**Tabella 39 – Rapportar ta' derivattiv ta' ekwità**

| Nru       | Kamp                                       | Eżempju                 | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------|--------------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tabella 1 |                                            |                         | <ValtnUpd><br><CtrPtySpcfcData><br><CtrPty><br><RptgCtrPty><br><Id><Lgl><LEI><br>12345678901234500000<br></LEI></Lgl></Id><br><Ntr><br><FI><br><Sctr><br><Cd>CDTI</Cd><br></Sctr><br><ClrThrshld>true<br></ClrThrshld><br></FI><br></Ntr><br><DrctnOrSd><Drctn><br><CtrPtySd>SLLR</CtrPtySd><br></Drctn></DrctnOrSd><br></RptgCtrPty><br><OthrCtrPty><br><IdTp><br><Lgl><br><LEI>ABCDEFGHIIJKLMNOPQRST<br></LEI><br></Lgl><br></IdTp><br><Ntr><br><FI><br><Sctr><br><Cd>INVF</Cd><br></Sctr><br><ClrThrshld>true<br></ClrThrshld><br></FI><br></Ntr><br></OthrCtrPty><br><SubmitgAgt><br><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></SubmitgAgt><br><NttyRspnsblForRpt><br><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></NttyRspnsblForRpt><br></CtrPty><br><Valtn><br><CtrctVal><br><Amt Ccy="EUR">6827412379 |
| 1         | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-02-24T17:00:00Z    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 2         | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3         | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 4         | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 5         | Natura tal-kontroparti 1                   | F                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 6         | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | CDTI                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 7         | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | VERU                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 8         | Tip ta’ identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 9         | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIIJKLMNOPQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 11        | Natura tal-kontroparti 2                   | F                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 12        | Settur korporattiv tal-kontroparti 2       | INVF                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 17        | Direzzjoni                                 | SLLR                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| Tabella 2 |                                            |                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 1         | UTI                                        | AAAAABBBBBCCCCDDDD<br>D |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 5         | ID tal-PTRR                                |                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 9         | Klassifikazzjoni tal-prodott               | SESDXC                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 10        | Tip ta’ kuntratt                           | SWAP                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 11        | Klassi tal-assi                            | EQUI                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 13        | Tip ta’ identifikazzjoni tas-sottostanti   | I                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 14        | Identifikazzjoni tas-sottostanti           | ES1234567890            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

**Tabella 39 – Rapportar ta' derivattiv ta' ekwità**

| Nru | Kamp                                   | Eżempju              | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----|----------------------------------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 21  | Ammont tal-valwazzjoni                 | 6827412379           | <pre> &lt;/Amt&gt; &lt;/CtrctVal&gt; &lt;TmStmp&gt;2021-03-02T17:00:00Z &lt;/TmStmp&gt; &lt;Tp&gt;MTMO&lt;/Tp&gt; &lt;/Valtn&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;2021-02-24T17:00:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstClss&gt;EQUI&lt;/AsstClss&gt;     &lt;PdctClssfctn&gt;SESDXC   &lt;/PdctClssfctn&gt;   &lt;UndrlygInstrm&gt;&lt;ISIN&gt;     ES1234567890   &lt;/ISIN&gt;&lt;/UndrlygInstrm&gt;   &lt;SttlmCcy&gt;&lt;Ccy&gt;EUR&lt;/Ccy&gt;   &lt;/SttlmCcy&gt; &lt;/CtrctData&gt; &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       AAAAABBBBCCCCDDDDDD     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;CollPrtf1Cd&gt;     &lt;Prtf1&gt;&lt;NoPrtf1&gt;NOAP   &lt;/NoPrtf1&gt;&lt;/Prtf1&gt;   &lt;/CollPrtf1Cd&gt;   &lt;PltfmIdr&gt;XXXX&lt;/PltfmIdr&gt;   &lt;NtnlAmt&gt;     &lt;FrstLeg&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;         1000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/FrstLeg&gt;     &lt;/NtnlAmt&gt;     ...   &lt;DlvryTp&gt;CASH&lt;/DlvryTp&gt; </pre> |
| 22  | Munita tal-valwazzjoni                 | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 23  | Kronogramma tal-valwazzjoni            | 2021-03-02T17:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 24  | Metodu tal-valwazzjoni                 | MTMO                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 26  | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 30  | Obbligu tal-ikklerjar                  | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 31  | Ikklerjat                              | LE                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 37  | Intragrupp                             | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 38  | PTRR                                   | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 41  | Ċentru tal-eżekuzzjoni                 | XXXX                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni            | 2021-02-23T17:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 43  | Data effettiva                         | 2021-02-24           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 44  | Data ta' skadenza                      | 2024-06-15           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 47  | Tip ta' konsenja                       | FLUS KONTANTI        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1      | 1,000,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 56  | Munita nozzjonali 1                    | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 151 | Tip ta' azzjoni                        | VALU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 152 | Tip ta' event                          |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

**Tabella 39 – Rapportar ta' derivattiv ta' ekwità**

| Nru | Kamp   | Eżempju | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-----|--------|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 154 | Livell | TCTN    | <pre> &lt;ExctnTmStmp&gt;2021-02-23T17:00:00Z&lt;/ExctnTmStmp&gt; &lt;FctvDy&gt;2021-02-24&lt;/FctvDy&gt; &lt;XprtnDt&gt;2024-06-15&lt;/XprtnDt&gt; &lt;PstTradRskRdctnFlg&gt;false&lt;/PstTradRskRdctnFlg&gt; &lt;TradClr&gt; &lt;ClrOblgtn&gt;FLSE&lt;/ClrOblgtn&gt; &lt;ClrSts&gt;&lt;NonClrd&gt;&lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;&lt;/NonClrd&gt;&lt;/ClrSts&gt; &lt;IntraGrp&gt;true&lt;/IntraGrp&gt; &lt;/TradClr&gt;  ... &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lvl&gt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/ValtnUpd&gt; </pre> |

**Tabella 3**

|    |                                                                 |                      |                           |
|----|-----------------------------------------------------------------|----------------------|---------------------------|
| 7  | Kronogramma tal-kollateral                                      | 2021-03-24T17:00:00Z | <MrgnUpd>                 |
| 8  | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral                          | FALZ                 | <EvtDt>2021-03-24</EvtDt> |
| 9  | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral                             |                      | <TxId>                    |
| 10 | UTI                                                             | AAAAABBBBBCCCCCDDDD  | <UnqTxId>                 |
| 11 | Kategorija ta' kollateralizzazzjoni                             | FLCL                 | AAAAABBBBBCCCCCDDDD       |
| 12 | Marġni inizjali depożitat mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) | 5,000,000            | </UnqTxId>                |
| 13 | Marġni inizjali depożitat mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)   | 4,500,000            | </TxId>                   |
| 14 | Munita tal-marġni inizjali depożitat                            | EUR                  | <Coll>                    |
| 15 | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-                          | 1,000,000            | <CollPrtflCd>             |

**Tabella 39 – Rapportar ta' derivattiv ta' ekwità**

| Nru | Kamp                                                                 | Eżempju    | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----|----------------------------------------------------------------------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | kontroparti 1<br>(qabel il-haircut)                                  |            | <pre> &lt;VartnMrgnPstdPstHrcut&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;800000&lt;/Amt&gt; &lt;/VartnMrgnPstdPstHrcut&gt; &lt;/PstdMrgnOrColl&gt; &lt;RcvdMrgnOrColl&gt;   &lt;InitlMrgnRcvdPreHrcut&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;5000000&lt;/Amt&gt;   &lt;/InitlMrgnRcvdPreHrcut&gt;   &lt;InitlMrgnRcvdPstHrcut&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;4300000&lt;/Amt&gt;   &lt;/InitlMrgnRcvdPstHrcut&gt; &lt;/RcvdMrgnOrColl&gt; &lt;/MrgnUpd&gt; </pre> |
| 16  | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-kontroparti 1 (wara l-haircut) | 800,000    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 17  | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni depożitati                         | EUR        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 20  | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)         | 5,000,000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 21  | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)           | 4,300,000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 22  | Munita tal-marġni inizjali miġbur                                    | EUR        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 23  | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)  |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 24  | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)    |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 25  | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni miġbur                             |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 28  | Tip ta' azzjoni                                                      | MARU       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 29  | Data tal-event                                                       | 2021-03-24 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

456. Eżempju ieħor ta' kuntratt tal-futuri fuq l-ekwitatijiet ETDs jinstab fit-taqsima 3.8.

## 4.8 Rapportar ta' derivattivi ta' kreditu

457. Derivattiv ta' kreditu huwa kuntratt finanzjarju li fih is-sottostanti huwa assi ta' kreditu (strument ta' dejn jew ta' dħul fiss). L-iskop ta' derivattiv ta' kreditu huwa li jittrasferixxi r-riskju ta' kreditu mingħajr ma jittrasferixxi l-assi nnifsu. It-tip ta' kuntratt għandu jiġi speċifikat fil-kamp 2.10 u l-klassi tal-assi ("CRDT") għandha tiġi speċifikata fil-kamp 2.11.

458. Swaps tar-Redditu Totali (definiti hawn fuq fit-taqsima Rapportar tad-derivattivi ta' ekwità ta' dawn il-Linji Gwida) għandhom jiġu klassifikati abbażi tas-sottostanti. Pereżempju, Swap tar-Redditu Totali fuq indiċi tal-ekwità għandu jiġi rapportat bil-valur "EQUI" fil-kamp 2.11 filwaqt li Swap tar-Redditu Totali fuq bond jew self għandu jiġi rapportat bil-valur "CRDT".
459. Fil-każ tad-derivattivi ta' kreditu wara bidla fil-fattur tal-indiċi (kamp 2.147 fl-RTS dwar ir-rapportar) minħabba avvenimenti ta' kreditu, il-kontropartijiet m'għandhomx jimmodifikaw in-nozzjonali, iżda pjuttost huma għandhom jaġġornaw biss il-fattur tal-indiċi.
460. Fir-rigward tar-rapportar tal-entità referenzjarja (kamp 2.144) għad-derivattivi ta' kreditu, il-kodiċijiet ISO 3166 u ISO 3166-2 għandhom jintużaw biss fil-każ ta' derivattivi tal-kreditu meta l-entità referenzjarja tkun supranazzjonali, sovrana jew muniċipali, rispettivament. Fil-każijiet l-oħra kollha, l-entità referenzjarja għandha tiġi identifikata b'LEI.
461. Fil-każ tar-rapportar ta' CDS b'pagament ta' kupun imwettaq f'pagament uniku fid-data ta' maturità iktar milli bi frekwenza fix-xahar, trimestrali, semiannwali jew annwali, il-kontropartijiet għandhom jimlew il-kamp 2.81 "Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1" tal-ITS dwar ir-rapportar bl-użu tal-kodiċi "EXPI" = pagament fl-iskadenza.
462. Is-segmenti tal-indiċi tas-CDS huma obbligati ta' dejn kollateralizzati (CDOs) sintetiku standardizzati bbażati fuq indiċi tas-CDS, fejn kull segment jaġġmel referenza għal segment differenti tad-distribuzzjoni tat-telf tal-indiċi tas-CDS sottostanti. Il-livell tar-riskju ta' segment jonqos mas-superjorità tas-segment fl-istruttura tal-kapital tat-titolizzazzjoni. Dan jippermetti lill-investituri jiehdu skoperturi għal segmenti speċifiċi tal-indiċi tad-distribuzzjoni tat-telf ta' inadempjenza tas-CDS fejn kull segment għandu sensitività differenti għall-korrelazzjonijiet ta' riskju ta' kreditu fost l-entitajiet fl-indiċi.
463. Is-segmenti ta' indiċi tas-CDS li jassorbu t-telf f'sekwenza huma definiti b'punt ta' attakkament u b'punt ta' distakkament. Huma definiti fil-kampijiet 2.149 u 2.150 tal-RTS dwar ir-rapportar.
464. Iż-żewġ elementi tad-*data*, il-punti ta' attakkament u ta' distakkament, mhumix applikabbli jekk id-derivattiv ma jkunx derivattiv tas-segment tas-CDS (basket tal-indiċi jew personalizzat).
465. Pereżempju, in-nozzjonali f'segment b'punt ta' attakkament ta' 3 % u b'punt ta' distakkament ta' 6 % jitnaqqas wara li jkun hemm 3 % ta' telf fil-portafoll. 6 % ta' telf fil-portafoll jeżawrixi n-nozzjonali tas-segment.
466. It-tip ta' event "event ta' kreditu" japplika biss għad-derivattivi ta' kreditu. Huwa definit bħala event ta' kreditu li jirriżulta f'modifika ta' derivattiv ta' kreditu, fil-livell tan-negozju jew tal-pożizzjoni. Għal iktar dettalji ara t-taqsima 3.6 f'dawn il-Linji Gwida.
467. F'konformità mal-Artikolu 4 tal-ITS dwar ir-rapportar, fil-każ ta' strumenti derivattivi għat-trasferiment tar-riskju tal-kreditu bħala derivattivi ta' kreditu

(primarjament CDSs), il-kontroparti li tixtri l-protezzjoni għandha tiġi identifikata bħala x-xerrej u l-kontroparti li tbigh il-protezzjoni għandha tiġi identifikata bħala l-bejjiegħ. Fil-każ tal-opzjonijiet u tal-iswapzjonijiet, ir-regola skont l-Artikolu 4(2) tal-ITS dwar ir-rapportar tapplika, jiġifieri x-xerrej tal-opzjoni/tal-iswapzjoni għandu jiġi identifikat bħala x-xerrej.

468. Il-prezz tal-iswaps ta' inadempjenza ta' kreditu u tal-iswaps tar-redditu totali ta' kreditu għandu jiġi rapportat fil-kampijiet "Rata fissa", "Firxa" u "Ammont ieħor ta' pagament" (bil-kamp "Tip ieħor ta' pagament" = "UFRO"). Iktar dettalji huma pprovduti fit-taqsima 3.17 ta' dawn il-Linji Gwida.
469. Għall-iswaps ta' Inadempjenza ta' Kreditu (CDS), meta sottostanti jiġi rapportat, l-ISIN tal-obbligu ta' referenza għandu jiġi pprovdut (kamp 2.14).
470. Il-prezz tal-eżerċitar tal-iswapzjonijiet ta' kreditu fil-firxa, meta l-prezz tal-eżerċitar ikun espress bħala perċentwal, għandu jiġi rapportat b'valur sa massimu ta' 11-il karattru numeriku inkluż sa massimu ta' 10 pożizzjonijiet deċimali; eż.: 2.1 minflok 2.1 % (kampijiet 2.134 u 2.137).
471. Is-superjorità tat-titolu ta' dejn, jew tal-basket jew tal-indiċi tad-dejn sottostanti għal derivattiv għandha tiġi rapportata fil-kamp "Superjorità" għad-derivattivi ta' kreditu (kamp 2.143).
472. Jekk ikun applikabbli, in-numru tas-serje tal-kompożizzjoni tal-indiċi użat għandu jiġi rapportat għad-derivattivi ta' kreditu kif ukoll verżjoni ġdida ta' serje tinħareġ jekk wieħed mill-kostitwenti jsir inadempjenti u l-indiċi jkollu jiġi ponderat mill-ġdid biex jitqies l-għadd il-ġdid tal-kostitwenti totali fl-indiċi (kampijiet 2.145 u 2.146).
473. Jekk kuntratt tad-derivattiv ikun segmentat, il-kamp 2.148 "Segment" għandu jiġi rapportat bħala "Veru".
474. Il-kamp 2.47 "Tip ta' konsenja" għad-derivattivi ta' kreditu fil-każ ta' rkant tal-event ta' kreditu għandu jiġi rapportat bħala "CASH" (Fi flus kontanti) għad-derivattivi ta' kreditu li jiġu saldati bil-flus kontanti. Madankollu, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw "PHYS" (Fizika) fil-każ ta' konsenja fizika tas-sottostanti tad-derivattiv ta' kreditu mill-kontroparti li hija x-xerrej tal-protezzjoni lill-kontroparti l-oħra.

#### 4.8.1 CDS

475. Ditta tal-investiment Franciża tirrapporta l-akkwist reċenti, ipprezzat b'mudell intern, ta' protezzjoni tal-inadempjenza. Din il-protezzjoni hija bbażata fuq derivattiv bilaterali li daħlet fih ma' entità tal-investiment Irlandiża. In-nozzjonali tad-derivattiv huwa EUR 520,000,000. Id-derivattiv jaqa' fil-kategorija tad-derivattiv tas-segment tas-CDS b'punt ta' attakkament ta' 10 % u b'punt ta' distakkament ta' 20 %. Is-sottostanti tad-derivattiv jikkorrispondi għal ċerta serje tal-indiċi Itraxx Europe. Kupun mensili fiss ta' 1 % jithallas. Id-derivattiv huwa parzjalment kollateralizzat mix-xerrej.

**Tabella 40 - Rapportar ta' CDS**

| Tabella 40 - Rapportar ta' CDS |                                            |                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                            | Kamp                                       | Eżempju                     | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| Tabella 1                      |                                            |                             | <New><br><CtrPtySpcfcData><br><CtrPrty><br><RptgCtrPty><br><Id><br><Lgl><br><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></Lgl><br></Id><br><Ntr><br><FI><br><Sctr><br><Cd>INVF</Cd><br></Sctr><br><ClrThrshld>true<br></ClrThrshld><br></FI><br></Ntr><br><DrctnOrSd><br><Drctn><br><CtrPtySd>BYER<br></CtrPtySd><br></Drctn><br></DrctnOrSd><br></RptgCtrPty><br><OthrCtrPty><br><Id><br><Lgl><br><LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI><br></Lgl><br></Id><br><Ntr><br><FI><br><Sctr><br><Cd>INVF</Cd><br></Sctr><br></FI><br></Ntr><br></OthrCtrPty><br><SubmitgAgt><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></SubmitgAgt><br><NttyRspnsblForRpt><br><LEI><br>12345678901234500000</LEI><br></NttyRspnsblForRpt><br></CtrPrty><br><Valtn><br><CtrctVal> |
| 1                              | Kronogramma tar-rapportar                  | 2020-05-19T14:23:26Z        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2                              | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3                              | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 4                              | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 5                              | Natura tal-kontroparti 1                   | F                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 6                              | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | INVF                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 7                              | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | VERU                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 8                              | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 9                              | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST<br>T     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 11                             | Natura tal-kontroparti 2                   | F                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 12                             | Settur korporattiv tal-kontroparti 2       | INVF                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 17                             | Direzzjoni                                 | BYER                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Tabella 2                      |                                            |                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 1                              | UTI                                        | AABBCCDDEEFFGGHHIIP<br>P    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 5                              | ID tal-PTRR                                |                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 9                              | Klassifikazzjoni tal-prodott               | SCVCCA                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 10                             | Tip ta' kuntratt                           | SWAP                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 11                             | Klassi tal-assi                            | CRDT                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 13                             | Tip ta' identifikazzjoni tas-sottostanti   | X                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 14                             | Identifikazzjoni tas-sottostanti           |                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 15                             | Indikatur tal-indiçi sottostanti           |                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 16                             | Isem tal-indiçi sottostanti                | SERJE ITRAXX EUROPE<br>28 V |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

Tabella 40 - Rapportar ta' CDS

| Nru | Kamp                                                                            | Eżempju              | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----|---------------------------------------------------------------------------------|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 21  | Ammont tal-valwazzjoni                                                          | 8,954,030.09         | <pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;   8954030.09&lt;/Amt&gt; &lt;/CtrctVal&gt; &lt;TmStmp&gt;   2020-05-19T14:23:26Z &lt;/TmStmp&gt; &lt;Tp&gt;MTMO&lt;/Tp&gt; &lt;/Valtn&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;2020-05-19T   14:23:26Z&lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;     &lt;AsstCls&gt;CRDT&lt;/AsstCls&gt;     &lt;PdctClsfctn&gt;SCVCCA     &lt;/PdctClsfctn&gt;     &lt;UndrlygInstrm&gt;       &lt;Indx&gt;         &lt;Nm&gt;ITRAXX EUROPE SERIES           28 V&lt;/Nm&gt;       &lt;/Indx&gt;     &lt;/UndrlygInstrm&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxId&gt;         AABBCDDDEEFF         GHHIIPP       &lt;/UnqTxId&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;CollPrtf1Cd&gt;       &lt;Prtf1&gt;         &lt;NoPrtf1&gt;NOAP&lt;/NoPrtf1&gt;       &lt;/Prtf1&gt;     &lt;/CollPrtf1Cd&gt;     &lt;PltfmIdr&gt;XXXX&lt;/PltfmIdr&gt;     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           520000000&lt;/Amt&gt;         &lt;/FrstLeg&gt;       &lt;/NtnlAmt&gt;       &lt;DlvryTp&gt;PHYS&lt;/DlvryTp&gt;       &lt;ExctnTmStmp&gt;2020-05-18         T14:39:32Z&lt;/ExctnTmStmp&gt;       &lt;FctvDt&gt;2020-05-19&lt;/FctvDt&gt;       &lt;XprtnDt&gt;2022-12-20&lt;/XprtnDt&gt;       &lt;PstTradRskRdctnEvt&gt;         false&lt;/PstTradRskRdctnEvt&gt;       &lt;DerivEvt&gt;         &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt;       &lt;/DerivEvt&gt;       &lt;TradConf&gt; </pre> |
| 22  | Munita tal-valwazzjoni                                                          | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 23  | Kronogramma tal-valwazzjoni                                                     | 2020-05-19T14:23:26Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 24  | Metodu tal-valwazzjoni                                                          | MTMO                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 26  | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral                                          | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 28  | Kronogramma tal-konferma                                                        | 2020-05-18T14:39:32Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 29  | Konfermat                                                                       | ECNF                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 30  | Obbligu tal-ikklerjar                                                           | UKWN                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 31  | Ikklerjat                                                                       | LE                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 37  | Intragrupp                                                                      | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 38  | PTRR                                                                            | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 41  | Ċentru tal-eżekuzzjoni                                                          | XXXX                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 42  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                                                     | 2020-05-18T14:39:32Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 43  | Data effettiva                                                                  | 2020-05-19           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 44  | Data ta' skadenza                                                               | 2022-12-20           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 47  | Tip ta' konsenja                                                                | PHYS                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 55  | Ammont nozzjonali tal-komponent 1                                               | 520,000,000          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 56  | Munita nozzjonali 1                                                             | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 79  | Rata fissa tal-komponent 1 jew tal-kupun                                        | 0.01                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 80  | Konvenzjoni tal-għadd tal-jiem tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1     | A004                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 81  | Perjodu ta' frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1 | KULL XAHAR           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 82  | Multiplikatur tal-perjodu ta'                                                   | 1                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

Tabella 40 - Rapportar ta' CDS

| Nru | Kamp                                                                | Eżempju | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | frekwenza tal-pagament tar-rata fissa jew tal-kupun tal-komponent 1 |         | <pre> &lt;Confd&gt;   &lt;Tp&gt;ECNF&lt;/Tp&gt;   &lt;TmStmp&gt;     2020-05-18T14:39:32Z   &lt;/TmStmp&gt; &lt;/Confd&gt; &lt;/TradConf&gt; &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrOblgtn&gt;UKWN&lt;/ClrOblgtn&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;NonClrd&gt;&lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;   &lt;/NonClrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt;   &lt;IntraGrp&gt;&gt;false&lt;/IntraGrp&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;IntrstRate&gt;   &lt;FrstLeg&gt;     &lt;Fxd&gt;       &lt;Rate&gt;         &lt;Rate&gt;0.01&lt;/Rate&gt;       &lt;/Rate&gt;       &lt;DayCnt&gt;&lt;Cd&gt;A004     &lt;/Cd&gt;&lt;/DayCnt&gt;     &lt;PmtFrqcy&gt;       &lt;Term&gt;         &lt;Unit&gt;MNTH&lt;/Unit&gt;         &lt;Val&gt;1&lt;/Val&gt;       &lt;/Term&gt;     &lt;/PmtFrqcy&gt;     &lt;/Fxd&gt;     &lt;/FrstLeg&gt;   &lt;/IntrstRate&gt;   &lt;Cdt&gt;     &lt;Snrtty&gt;SNDB&lt;/Snrtty&gt;     &lt;Srs&gt;28&lt;/Srs&gt;     &lt;Vrsn&gt;2&lt;/Vrsn&gt;     &lt;IndxFctr&gt;1&lt;/IndxFctr&gt;     &lt;Trch&gt;       &lt;Trnchd&gt;         &lt;AttchmntPt&gt;0.10       &lt;/AttchmntPt&gt;         &lt;DtchmntPt&gt;0.20       &lt;/DtchmntPt&gt;       &lt;/Trnchd&gt;     &lt;/Trch&gt;   &lt;/Cdt&gt; &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 143 | Superjorità                                                         | SNDB    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 144 | Entità referenzjarja                                                |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 145 | Serje                                                               | 28      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 146 | Verżjoni                                                            | 2       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 147 | Fattur tal-indiċi                                                   | 1       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 148 | Segment                                                             | VERU    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 149 | Punt ta' attakkament tal-indiċi tas-CDS                             | 0.10    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 150 | Punt ta' distakkament tal-indiċi tas-CDS                            | 0.20    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 151 | Tip ta' azzjoni                                                     | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 152 | Tip ta' event                                                       | TRAD    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 154 | Livell                                                              | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

**Tabella 40 - Rapportar ta' CDS**

| Nru       | Kamp                                                                   | Eżempju              | Skema XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----------|------------------------------------------------------------------------|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Tabella 3 |                                                                        |                      | <pre> &lt;MrgnUpd&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-05-18&lt;/EvtDt&gt;   &lt;Coll&gt;     &lt;CollPrtf1Cd&gt;       &lt;Prtf1&gt;         &lt;NoPrtf1&gt;NOAP&lt;/NoPrtf1&gt;       &lt;/Prtf1&gt;     &lt;/CollPrtf1Cd&gt;     &lt;CollstnCtgy&gt;PRC1&lt;/CollstnCtgy&gt;     &lt;TmStmp&gt;2020-05-18T14:39:32Z&lt;/TmStmp&gt;   &lt;/Coll&gt;   &lt;PstdMrgnOrColl&gt;     &lt;VartnMrgnPstdPreHrcut&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/Amt&gt;     &lt;/VartnMrgnPstdPreHrcut&gt;     &lt;VartnMrgnPstdPstHrcut&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;745000&lt;/Amt&gt;     &lt;/VartnMrgnPstdPstHrcut&gt;   &lt;/PstdMrgnOrColl&gt; &lt;/MrgnUpd&gt; </pre> |
| 7         | Kronogramma tal-kollateral                                             | 2020-05-18T14:39:32Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 8         | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral                                 | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 9         | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral                                    |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 11        | Kategorija ta' kollateralizzazzjoni                                    | PRC1                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 12        | Marġni inizjali depożitat mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)        |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 13        | Marġni inizjali depożitat mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)          |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 14        | Munita tal-marġni inizjali depożitat                                   |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 15        | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) | 1,000,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 16        | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)   | 745,000              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 17        | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni depożitati                           | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 20        | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)           |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 21        | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)             |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 22        | Munita tal-marġni inizjali miġbur                                      |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 23        | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)    |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

**Tabella 40 - Rapportar ta' CDS**

| Nru | Kamp                                                              | Eżempju    | Skema XML |
|-----|-------------------------------------------------------------------|------------|-----------|
| 24  | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut) |            |           |
| 25  | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni miġbur                          |            |           |
| 28  | Tip ta' azzjoni                                                   | MARU       |           |
| 29  | Data tal-event                                                    | 2020-05-18 |           |

## 4.9 Rapportar ta' derivattivi ta' komoditajiet

476. It-Tabella 2 tal-RTS dwar ir-rapportar fiha kampijiet dedikati għar-rapportar tad-derivattivi ta' komoditajiet: kampijiet 2.116-2.118 għad-derivattivi ta' komoditajiet kollha u kampijiet addizzjonali 2.119-2.131 għad-derivattivi tal-enerġija.
477. B'mod partikolari, il-klassifikazzjoni tal-komoditajiet għandha tiġi rapportata fil-kampijiet 2.116-2.118 f'konformità mal-kategoriji speċifikati fit-Tabella 4 tal-ITS dwar ir-rapportar. Il-klassifikazzjoni rapportata tal-komodità sottostanti għandha tkun kemm jista' jkun granulari. Pereżempju, fil-każ tad-derivattivi fuq id-deheb, il-kontroparti għandha tispeċifika "Metalli", "Prezzjuż" u "Deheb" fil-kampijiet 2.116, 2.117 u 2.118, rispettivament. Biss jekk il-komodità sottostanti ma tikkorrispondi għall-ebda kategorija speċifika inkluża fl-ITS dwar ir-rapportar, għandha tiġi rapportata bħala "Oħrajn". Fil-każ li l-ebda valur speċifiku ma ġie stabbilit fl-ITS dwar ir-rapportar għal prodott partikolari għall-kampijiet 2.117 u 2.118 (eż. għall-kategorija "Eżotiċi Multikomoditajiet"), il-kontroparti m'għandha tirrapporta l-ebda valur għal dawn il-kampijiet, f'konformità mal-iskema XML.
478. Il-kontropartijiet m'għandhomx jidentifikaw il-komoditajiet fil-kampijiet tal-munita, anki jekk kodiċi dedikata ġie deżinjat għal tali komodità fl-istandard ISO 4217 (eż. XAU għad-deheb jew XBA għall-fidda). Il-komoditajiet għandhom jiġu identifikati biss permezz tal-kampijiet tal-klassifikazzjoni tal-komodità.
479. Il-kampijiet tal-klassifikazzjoni tal-komodità (2.116-2.118) mhumex ripetibbli. Għalhekk, fil-każ tal-iswaps tal-komoditajiet li jinkludu żewġ komoditajiet sottostanti, il-kontroparti għandha tirrapporta tali swap bħala negozju kumpless magħmul minn żewġ forwards ta' komodità u timla l-ID tal-Pakkett fiż-żewġ rapporti (ara t-taqsim 3.28).
480. Fil-każ tad-derivattivi bbażati fuq l-elettriku jew fuq il-gass naturali, il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw il-kampijiet 2.119-2.131 (flimkien ma' dettalji rapportabbli rilevanti oħra dwar id-derivattiv u l-kontropartijiet, kif muri f'taqsimiet oħra).
481. Il-kampijiet 2.122-2.131 għad-derivattivi tal-enerġija huma ripetibbli. Barra minn hekk, għall-kamp 2.127 "Jiem tal-ġimgħa" huwa possibbli li jiġu rapportati diversi

valuri, eż. MOND, TUES (Tnejn-Tlieta) jew WDAY, XBHL (matul il-ġimgħa minbarra festi pubbliċi) jew kombinamenti oħra.

#### 4.9.1 Futuri tal-elettriku

482. Tabella 41 turi eżempju ta' futur tat-tagħbija massima fuq il-prezz tal-elettriku fis-suq tal-operaturi Spanjol. Il-kuntratt hu negozjat f'MWh/siegħa u l-konsenja għandha ssir fit-tieni trimestru 2022 għal 100 MWh għal 58 ewro.

| Tabella 41- Rapportar ta' futur tal-elettriku ta' tagħbija massima |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------------------------------------------------------------------|--------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                | Kamp         | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 116                                                                | Prodott bażi | NRGY    | <pre> &lt;Cmmdty&gt;   &lt;Ngry&gt;     &lt;Elctrcty&gt;       &lt;BasePdct&gt;NRGY&lt;/BasePdct&gt;       &lt;SubPdct&gt;ELEC&lt;/SubPdct&gt;       &lt;AddtlSubPdct&gt;PKLD       &lt;/AddtlSubPdct&gt;     &lt;/Elctrcty&gt;   &lt;/Ngry&gt; &lt;/Cmmdty&gt; &lt;NrgySpcfcAttrbts&gt;   &lt;DlvryPtOrZone&gt;     &lt;Cd&gt;10YES-REE-----0&lt;/Cd&gt;   &lt;/DlvryPtOrZone&gt;   &lt;IntrCnctnPt&gt;     &lt;Cd&gt;XXXXXXXXXXXXXXXXXX&lt;/Cd&gt;   &lt;/IntrCnctnPt&gt;   &lt;LdTp&gt;PKLD&lt;/LdTp&gt;   &lt;DlvryAttr&gt;     &lt;DlvryIntrvl&gt;       &lt;FrTm&gt;08:00:00Z&lt;/FrTm&gt;       &lt;ToTm&gt;19:59:59Z&lt;/ToTm&gt;     &lt;/DlvryIntrvl&gt;     &lt;DlvryDt&gt;       &lt;FrDt&gt;2022-04-01&lt;/FrDt&gt;       &lt;ToDt&gt;2022-06-30&lt;/ToDt&gt;     &lt;/DlvryDt&gt;     &lt;Drtn&gt;QURT&lt;/Drtn&gt;     &lt;WkDay&gt;WDAY&lt;/WkDay&gt;     &lt;DlvryCpcty&gt;       &lt;Qty&gt;100&lt;/Qty&gt;     &lt;/DlvryCpcty&gt;     &lt;QtyUnit&gt;       &lt;Cd&gt;MWH&lt;/Cd&gt;     &lt;/QtyUnit&gt;     &lt;PricTmIntrvlQty&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;58&lt;/Amt&gt; </pre> |

**Tabella 41- Rapportar ta' futur tal-elettriku ta' tagħbija massima**

| Nru | Kamp                                     | Eżempju            | Messaġġ XML                                               |
|-----|------------------------------------------|--------------------|-----------------------------------------------------------|
|     |                                          |                    | </PricTmIntrvlQty><br></DlvryAttr><br></NrgySpcfcAttrbts> |
| 117 | Prodott sekondarju                       | ELEC               |                                                           |
| 118 | Prodott sekondarju ulterjuri             | PKLD               |                                                           |
| 119 | Punt jew zona tal-konsenja               | 10YES-REE-----0    |                                                           |
| 120 | Punt ta' interkonnessjoni                | XXXXXXXXXXXXXXXXXX |                                                           |
| 121 | Tip ta' tagħbija                         | PKLD               |                                                           |
| 122 | Ħin tal-bidu tal-intervall tal-konsenja  | 08:00:00Z          |                                                           |
| 123 | Ħin tat-tmiem tal-intervall tal-konsenja | 19:59:59Z          |                                                           |
| 124 | Data tal-bidu tal-konsenja               | 2022-04-01         |                                                           |
| 125 | Data tat-tmiem tal-konsenja              | 2022-06-30         |                                                           |
| 126 | Durata                                   | QURT               |                                                           |
| 127 | Jiem tal-ġimgħa                          | WDAY               |                                                           |
| 128 | Kapaċità tal-konsenja                    | 100                |                                                           |
| 129 | Unità tal-kwantità                       | MWHH               |                                                           |
| 130 | Prezz għal kull kwantità għal            | 58                 |                                                           |

**Tabella 41- Rapportar ta' futur tal-elettriku ta' tagħbija massima**

| Nru | Kamp                                                              | Eżempju | Messaġġ XML |
|-----|-------------------------------------------------------------------|---------|-------------|
|     | kull intervall ta' żmien                                          |         |             |
| 131 | Munita tal-prezz għal kull kwantità għal kull intervall ta' żmien | EUR     |             |

## 5 Tabelli tal-kampijiet tal-EMIR

483. L-Artikolu 1(1) tal-RTS dwar ir-rapportar jipprevedi li “Ir-rapporti lir-repożitorji tat-tranzazzjonijiet skont l-Artikolu 9 tar-Regolament (UE) Nru 648/2012 għandhom jinkludu d-dettalji kompluti u preċiżi stipulati fit-Tabelli 1, 2 u 3 tal-Anness li jirrigwardaw id-derivattiv ikkonċernat.” Il-każijiet ta' użu inklużi fit-taqsimiet 5.1, 5.2 u 5.3 mhux neċessarjament ikunu jinkludu l-kampijiet kollha li jikkonċernaw id-derivattiv ikkonċernat, iżda jiffokaw fuq taqsimiet speċifiċi tal-kampijiet tad-*data* sabiex jipprovdu gwida iktar granulari u dettaljata dwar ir-rapportar mingħajr ebda ripetizzjoni jew inklużjoni mhux meħtieġa ta' elementi oħra tad-*data*.

484. Ir-regoli dwar il-validazzjoni jinkludu l-gwida kompluta dwar il-kampijiet applikabbli skont it-tip u l-livell ta' azzjoni, kif ukoll id-dipendenzi rilevanti.

485. It-taqsimiet li ġejjin jinkludu diversi xenarji u tabelli korrispondenti li jiċċaraw kif dawn ix-xenarji għandhom jiġu rapportati. Kull tabella turi l-kampijiet ta' rapportar skont l-ITS dwar ir-rapportar. Il-kolonna “Kamp” turi kull isem tal-kamp, u l-kolonna “Eżempju” tippovdi eżempju ta' dak li jiġi inkluż f'dak il-kamp. Il-kolonna finali intitolata “Messaġġ XML” turi l-format tal-messaġġ XML li għandu jiġi ppreżentat fir-rapport.

486. Sakemm ma jiġix iddikjarat mod ieħor fix-xenarju speċifiku, l-informazzjoni ta' sfond li ġejja tapplika għax-xenarji kollha stabbiliti fit-Taqsimi 6:

Il-kontroparti A hija kontroparti finanzjarja Ġermaniża identifikata bil-LEI 12345678901234500000

Il-kontroparti B hija kontroparti finanzjarja Taljana identifikata bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

Il-kontroparti C hija NFC- Spanjola identifikata bil-LEI 123456789ABCDEFGHIJK

Il-kontroparti D hija NFC+ Franciża identifikata bil-LEI 11223344556677889900

Il-kontroparti J taġixxi wkoll bħala membru tal-ikklerjar u hija identifikata bil-LEI  
 CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

Is-CCP O hija identifikata bil-LEI BBBBBBBBBB1111111111

## 5.1 Tabella 1 *Data* dwar il-kontroparti

487. Din it-taqsimha tal-Linji Gwida tagħti dettalji dwar il-mili tat-taqsimha tad-*data* dwar il-kontroparti għal diversi każijiet ta' użu differenti. Ir-rapportar attwali f'konformità mal-iskemi XML tal-ISO 20022 huwa pprovdut ukoll.
488. Meta derivattiv jiġi kklerjat, kull kontroparti għandha tirrapporta l-membri tal-ikklerjar tagħha fil-kamp "Membru tal-ikklerjar".
489. Meta tkun teżisti delega volontarja tar-rapportar jew tal-allokazzjoni ta' responsabbiltà, l-entità li tippreżenta rapport jew l-entità responsabbli mir-rapportar għandha tippreżenta d-*data* dwar il-kontroparti b'mod separat, u d-*data* dwar il-kuntratt u d-*data* dwar il-kollateral għal kull waħda miż-żewġ naħat irrapportati.
490. Meta jkun hemm każijiet ta' użu li jkopru żewġ każijiet ta' użu jew aktar inklużi hawn taht, il-kontropartijiet li jirrapportaw, l-entitajiet responsabbli mir-rapportar jew l-entitajiet li jippreżentaw rapport għandhom jinkludu d-dettalji rilevanti kollha abbażi tal-gwida ta' hawn taht.

| Tabella 42                                                                                                                   |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Każijiet tal-użu                                                                                                             |
| Opzjoni kklerjata bejn I-FCs (ETD)                                                                                           |
| Opzjoni kklerjata bejn I-FCs bi ftehim ta' delega volontarja (ETD)                                                           |
| Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs                                                                                           |
| Opzjoni OTC bejn I-NFC- u FC                                                                                                 |
| Opzjoni OTC bejn I-NFC- u NFC+                                                                                               |
| Tip ta' kuntratt OTC bejn I-FCs li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet "Direzzjoni tal-Komponent 1" u "Direzzjoni tal-Komponent 2" |

### 5.1.1 Opzjoni kklerjata bejn I-FCs (ETD)

491. Tabella 43 turi r-rapportar tal-opzjoni kklerjata ETD meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti A bil-LEI 12345678901234500000) tkun Kontroparti Finanzjarja Ġermaniża 'l fuq mil-limiti ta' kklerjar, tippreżenta r-rapport tagħha stess (jiġifieri m'hemm l-ebda entità li tippreżenta rapport separat) u hija l-entità responsabbli mir-rapportar. L-opzjoni hija konkluża mal-kontroparti 2 (il-kontroparti B bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) li tkun Kontroparti Finanzjarja Taljana 'l fuq mil-limitu ta' kklerjar. Il-kontroparti A taċċessa s-CCP permezz tal-membri tal-ikklerjar J (il-kontroparti J bil-LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC).

492. Għandu jiġi nnotat li l-kamp “Kontroparti ċentrali” jappartjeni għat-Tabella 2, u għalhekk il-mili tiegħu huwa kopert fit-Taqsima 5.2.

**Tabella 43 - Opzjoni Kklerjata bejn l-FCs (ETD)**

| Nru | Kamp                                       | Eżempju                    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|--------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03- 17T15:17:00Z      | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           12345678901234500000         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;FI&gt;           &lt;Sctr&gt;             &lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;           &lt;/Sctr&gt;           &lt;ClrThrshld&gt;true           &lt;/ClrThrshld&gt;         &lt;/FI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;         &lt;Drctn&gt;           &lt;CtrPtySd&gt;BYER           &lt;/CtrPtySd&gt;         &lt;/Drctn&gt;       &lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           ABCDEFGHIJKLMNOPQRST         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;FI&gt;           &lt;Sctr&gt;             &lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;           &lt;/Sctr&gt;           &lt;ClrThrshld&gt;true           &lt;/ClrThrshld&gt;         &lt;/FI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;RptgOblgtn&gt;true       &lt;/RptgOblgtn&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;SubmitgAgt&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/SubmitgAgt&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt; </pre> |
| 2   | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 3   | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 4   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 5   | Natura tal-kontroparti 1                   | F                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 6   | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | CDTI                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 7   | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 8   | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 9   | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 10  | Pajjiż tal-kontroparti 2                   |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 11  | Natura tal-kontroparti 2                   | F                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 12  | Settur korporattiv tal-kontroparti 2       | CDTI                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 13  | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2     | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 14  | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2    | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 15  | ID tas-sensar                              |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 16  | Membru tal-ikklerjar                       | CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC<br>C |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

**Tabella 43 - Opzjoni Kklerjata bejn I-FCs (ETD)**

| Nru | Kamp                                                                    | Eżempju | Messaġ XML                                                                                                                                                           |
|-----|-------------------------------------------------------------------------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 17  | Direzzjoni                                                              | BYER    | 12345678901234500000                                                                                                                                                 |
| 18  | Direzzjoni tal-komponent 1                                              |         | </LEI>                                                                                                                                                               |
| 19  | Direzzjoni tal-komponent 2                                              |         | </NttyRspnsblForRpt>                                                                                                                                                 |
| 20  | B'rabta diretta mal-attività kummerċjali jew mal-finanzjament tat-teżor |         | <ClrMmb><br><Lgl><LEI><br>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC<br></LEI></Lgl><br></ClrMmb><br></CtrPrty><br><RptgTmStmp>2020-05-19T<br>14:23:26Z</RptgTmStmp><br></CtrPtySpcfcData> |

### 5.1.2 Opzjoni kklerjata bejn I-FCs bi ftehim ta' delega volontarja (ETD)

493. Tabella 44 turi r-rapportar ta' opzjoni kklerjata ETD meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti A bil-LEI 12345678901234500000) tkun Kontroparti Finanzjarja Ġermaniża 'l fuq mil-limiti ta' kklerjar, tkun l-entità responsabbli mir-rapportar iżda tiddelega r-rapportar lill-kontroparti l-oħra (il-kontroparti B bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST). L-opzjoni hija konkluzja mal-kontroparti 2 (il-kontroparti B) li hija Kontroparti Finanzjarja Taljana 'l fuq mil-limitu ta' kklerjar.
494. Il-kontroparti A taċċessa s-CCP permezz tal-membri tal-ikklerjar J (il-kontroparti J bil-LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC).
495. Għandu jiġi nnotat li l-kamp "Kontroparti ċentrali" jappartjeni għat-Tabella 2, u għalhekk il-mili tiegħu huwa kopert fit-Taqsima 5.2.

**Tabella 44 - Opzjoni Kklerjata bejn I-FCs bi ftehim ta' delega volontarja (ETD)**

| Nru | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġ XML           |
|-----|--------------------------------------------|----------------------|----------------------|
| 1   | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03-17T15:17:00Z | <CtrPtySpcfcData>    |
| 2   | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | ABCDEFGHIJKLMNQRST   | <CtrPty>             |
| 3   | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 | <RptgCtrPty>         |
| 4   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 | <Id>                 |
| 5   | Natura tal-kontroparti 1                   | F                    | <Lgl><LEI>           |
| 6   | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | CDTI                 | 12345678901234500000 |

| Tabella 44 - Opzjoni Kklerjata bejn I-FCs bi ftehim ta' delega volontarja (ETD) |                                                                         |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|---------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                             | Kamp                                                                    | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 7                                                                               | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1                                  | VERU                 | <pre> &lt;Drctn&gt;   &lt;CtrPtySd&gt;BYER   &lt;/CtrPtySd&gt; &lt;/Drctn&gt; &lt;/DrctnOrSd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lgl&gt;       &lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lgl&gt;   &lt;/IdTp&gt;   &lt;Ntr&gt;     &lt;FI&gt;       &lt;Sctr&gt;         &lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;       &lt;/Sctr&gt;       &lt;ClrThrshld&gt;true       &lt;/ClrThrshld&gt;     &lt;/FI&gt;   &lt;/Ntr&gt;   &lt;RptOblgtn&gt;true   &lt;/RptOblgtn&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     ABCDEFGHIJKLMNOPQRST   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;ClrMmb&gt;   &lt;LEI&gt;     CCCCCCCCCCCCCCCCCC   &lt;/LEI&gt; &lt;/ClrMmb&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2021-03-17T15:17:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; </pre> |
| 8                                                                               | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2                                 | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 9                                                                               | Kontroparti 2                                                           | ABCDEFGHIJKLMNQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 10                                                                              | Pajjiż tal-kontroparti 2                                                |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 11                                                                              | Natura tal-kontroparti 2                                                | F                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 12                                                                              | Settur korporattiv tal-kontroparti 2                                    | CDTI                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 13                                                                              | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2                                  | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 14                                                                              | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2                                 | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 15                                                                              | ID tas-sensar                                                           |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 16                                                                              | Membru tal-ikklerjar                                                    | CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 17                                                                              | Direzzjoni                                                              | BYER                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 18                                                                              | Direzzjoni tal-komponent 1                                              |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 19                                                                              | Direzzjoni tal-komponent 2                                              |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 20                                                                              | B'rabta diretta mal-attività kummerċjali jew mal-finanzjament tat-teżor |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

### 5.1.3 Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs

496. Tabella 45 turi r-rapportar ta' opzjoni mhux ikklerjata meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti A bil-LEI 12345678901234500000) tkun Kontroparti Finanzjarja Ġermaniża 'l fuq mil-limiti ta' kklerjar, tkun l-entità responsabbli mir-rapportar u tirrapporta r-rapport tagħha stess. L-opzjoni hija konkluzja mal-kontroparti 2 (il-kontroparti B bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) li tkun Kontroparti Finanzjarja Taljana 'l fuq mil-limitu ta' kklerjar.

| Tabella 45 – Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                             | Kamp                                       | Eżempju               | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1                                               | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03- 17T15:17:00Z | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           12345678901234500000         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;FI&gt;&lt;Sctr&gt;           &lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;         &lt;/Sctr&gt;         &lt;ClrThrshld&gt;true         &lt;/ClrThrshld&gt;&lt;/FI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;         &lt;Drctn&gt;           &lt;CtrPtySd&gt;BYER         &lt;/CtrPtySd&gt;         &lt;/Drctn&gt;       &lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;LEI&gt;             ABCDEFGHIJKLMNOPQRST           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/IdTp&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;FI&gt;&lt;Sctr&gt;           &lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;         &lt;/Sctr&gt;         &lt;ClrThrshld&gt;true         &lt;/ClrThrshld&gt;&lt;/FI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;RptOblgtn&gt;true       &lt;/RptOblgtn&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt; </pre> |
| 2                                               | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 3                                               | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 4                                               | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 5                                               | Natura tal-kontroparti 1                   | F                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 6                                               | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | CDTI                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 7                                               | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | VERU                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

| Tabella 45 – Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs |                                         |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|-------------------------------------------------|-----------------------------------------|--------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                             | Kamp                                    | Eżempju                  | Messaġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 8                                               | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2 | VERU                     | <pre> &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2021-03-17T15:17:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; </pre> |
| 9                                               | Kontroparti 2                           | ABCDEFGHIJKLMNO<br>PQRST |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 10                                              | Pajjiż tal-kontroparti 2                |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 11                                              | Natura tal-kontroparti 2                | F                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 12                                              | Settur korporattiv tal-kontroparti 2    | CDTI                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 13                                              | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2  | VERU                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 14                                              | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2 | VERU                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 15                                              | ID tas-sensar                           |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 16                                              | Membru tal-ikklerjar                    |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 17                                              | Direzzjoni                              | BYER                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 18                                              | Direzzjoni tal-komponent 1              |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 19                                              | Direzzjoni tal-komponent 2              |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

| Tabella 45 – Opzjoni mhux ikklerjata bejn I-FCs |                                                                         |         |            |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|---------|------------|
| Nru                                             | Kamp                                                                    | Eżempju | Messaġ XML |
| 20                                              | B'rabta diretta mal-attività kummerċjali jew mal-finanzjament tat-teżor |         |            |

#### 5.1.4 Opzjoni OTC bejn NFC- u FC

497. Tabella 46 turi r-rapportar tal-opzjoni OTC meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti C bil-LEI 123456789ABCDEFGHIJK) tkun Kontroparti Mhux Finanzjarja Spanjola taħt il-limiti tal-ikklerjar. L-opzjoni hija konkluża mal-kontroparti 2 (il-kontroparti A bil-LEI 12345678901234500000) li hija Kontroparti Finanzjarja Ġermaniża fuq il-limitu ta' kklerjar. F'dan il-każ, il-kontroparti A hija l-entità responsabbli mir-rapportar u l-entità li tippreżenta rapport f'konformità mad-dispożizzjonijiet dwar l-allokazzjoni tar-responsabbiltà mir-rapportar.

| Tabella 46 – OTC bejn NFC- u FC |                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|---------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                             | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 1                               | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03-17T15:17:00Z | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           123456789ABCDEFGHIJK         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;NFI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Id&gt;K         &lt;/Id&gt;&lt;/Sctr&gt;         &lt;ClrThrshld&gt;false         &lt;/ClrThrshld&gt;         &lt;DrctlyLkdActvty&gt;           false         &lt;/DrctlyLkdActvty&gt;         &lt;/NFI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;         &lt;Drctn&gt;           &lt;CtrPtySd&gt;BYER           &lt;/CtrPtySd&gt;         &lt;/Drctn&gt;       &lt;/DrctnOrSd&gt; </pre> |
| 2                               | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3                               | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 4                               | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 123456789ABCDEFGHIJK |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 5                               | Natura tal-kontroparti 1                   | N                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 6                               | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | K                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 7                               | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

| Tabella 46 – OTC bejn NFC- u FC |                                                                     |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|---------------------------------|---------------------------------------------------------------------|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                             | Kamp                                                                | Eżempju              | Messaġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 8                               | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2                             | VERU                 | <pre> &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lgl&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lgl&gt;   &lt;/IdTp&gt;   &lt;Ntr&gt;     &lt;FI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Cd&gt;CDTI   &lt;/Cd&gt;&lt;/Sctr&gt;   &lt;ClrThrshld&gt;true   &lt;/ClrThrshld&gt;&lt;/FI&gt;   &lt;/Ntr&gt;   &lt;RptOblgtn&gt;true   &lt;/RptOblgtn&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2021-03-17T15:17:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; </pre> |
| 9                               | Kontroparti 2                                                       | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 10                              | Pajjiż tal-kontroparti 2                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 11                              | Natura tal-kontroparti 2                                            | F                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 12                              | Settur korporattiv tal-kontroparti 2                                | CDTI                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 13                              | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2                              | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 14                              | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2                             | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 15                              | ID tas-sensar                                                       |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 16                              | Membru tal-ikklerjar                                                | -                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 17                              | Direzzjoni                                                          | BYER                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 18                              | Direzzjoni tal-komponent 1                                          |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 19                              | Direzzjoni tal-komponent 2                                          |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 20                              | B'rabta diretta ma' attività kummerċjali jew finanzjament tat-teżor | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 154                             | Livell                                                              | TCTN                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

### 5.1.5 Opzjoni OTC bejn NFC- u NFC+

498. Tabella 47 turi r-rapportar tal-opzjoni OTC meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti C bil-LEI 123456789ABCDEFGHIJK) tkun Kontroparti Mhux Finanzjarja Spanjola taħt il-limiti tal-ikklerjar. L-opzjoni hija konkluża mal-kontroparti 2 (il-kontroparti D bil-LEI 11223344556677889900) li hija Kontroparti Mhux Finanzjarja Franciża fuq il-limitu tal-ikklerjar. Il-kontroparti C hija l-entità responsabbli mir-rapportar u l-entità li tippreżenta rapport.

| Tabella 47 – OTC bejn NFC- u NFC+ |                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                               | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 1                                 | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03-17T15:17:00Z | <pre> &lt;CtrPtySpfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           123456789ABCDEFGHJK         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;NFI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Id&gt;K         &lt;/Id&gt;&lt;/Sctr&gt;         &lt;ClrThrshld&gt;false         &lt;/ClrThrshld&gt;         &lt;DrctlyLkdActvty&gt;           false         &lt;/DrctlyLkdActvty&gt;         &lt;/NFI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;         &lt;Drctn&gt;           &lt;CtrPtySd&gt;BYER           &lt;/CtrPtySd&gt;         &lt;/Drctn&gt;       &lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;LEI&gt;             ABCDEFGHIJKLMNOPQRST           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/IdTp&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;NFI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Id&gt;L         &lt;/Id&gt;&lt;/Sctr&gt;         &lt;ClrThrshld&gt;true         &lt;/ClrThrshld&gt;         &lt;/NFI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;RptOblgtn&gt;true       &lt;/RptOblgtn&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;SubmitgAgt&gt;       &lt;LEI&gt;         123456789ABCDEFGHJK       &lt;/LEI&gt;     &lt;/SubmitgAgt&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;         123456789ABCDEFGHJK       &lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; </pre> |
| 2                                 | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 123456789ABCDEFGHJK  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 3                                 | Entità responsabbli mir-rapportar          | 123456789ABCDEFGHJK  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 4                                 | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 123456789ABCDEFGHJK  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 5                                 | Natura tal-kontroparti 1                   | N                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 6                                 | Settur korporattiv tal-kontroparti 1       | K                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 7                                 | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1     | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 8                                 | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 9                                 | Kontroparti 2                              | 11223344556677889900 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 10                                | Pajjiż tal-kontroparti 2                   |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 11                                | Natura tal-kontroparti 2                   | N                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 12                                | Settur korporattiv tal-kontroparti 2       | L                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 13                                | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2     | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 14                                | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2    | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 15                                | ID tas-sensar                              |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 16                                | Membru tal-ikklerjar                       |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 17                                | Direzzjoni                                 | BYER                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 18                                | Direzzjoni tal-komponent 1                 |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

| Tabella 47 – OTC bejn NFC- u NFC+ |                                                                     |         |                                                                                                                                                   |
|-----------------------------------|---------------------------------------------------------------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                               | Kamp                                                                | Eżempju | Messaġ XML                                                                                                                                        |
| 19                                | Direzzjoni tal-komponent 2                                          |         | <pre> &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt; 2021-03-17T15:17:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; </pre> |
| 20                                | B'rabta diretta ma' attività kummerċjali jew finanzjament tat-teżor | FALZ    |                                                                                                                                                   |
| 154                               | Livell                                                              | TCTN    |                                                                                                                                                   |

#### 5.1.6 Tip ta' kuntratt OTC li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet “Direzzjoni tal-Komponent 1” u “Direzzjoni tal-Komponent 2” bejn FCs

499. Tabella 48 turi r-rapportar ta' tip ta' Kuntratt OTC li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet “Direzzjoni tal-Komponent 1” u “Direzzjoni tal-Komponent 2” meta l-kontroparti 1 (il-kontroparti A bil-LEI 12345678901234500000) tkun Kontroparti Finanzjarja Ġermaniża 'l fuq mil-limiti tal-ikklerjar. Il-kuntratt huwa konkluż mal-kontroparti 2 (il-kontroparti B bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) li hija Kontroparti Finanzjarja Taljana 'l fuq mil-limitu tal-ikklerjar.

| Tabella 48 - Tip ta' kuntratt OTC li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet Direzzjoni tal-Komponent 1 u Direzzjoni tal-Komponent 2 bejn FCs |                                            |                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                                 | Kamp                                       | Eżempju               | Messaġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 1                                                                                                                                   | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03- 17T15:17:00Z | <pre> &lt;&lt;CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CtrPty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt; 12345678901234500000 &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Ntr&gt; &lt;FI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt; &lt;/Sctr&gt;&lt;ClrThrshld&gt;true &lt;/ClrThrshld&gt;&lt;/FI&gt; &lt;/Ntr&gt; &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt; &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;MAKE &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt; &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;TAKE &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt; &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt; </pre> |
| 2                                                                                                                                   | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 3                                                                                                                                   | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 4                                                                                                                                   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 5                                                                                                                                   | Natura tal-kontroparti 1                   | F                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

**Tabella 48 - Tip ta' kuntratt OTC li jeħtieġ il-mili tal-kampijiet Direzzjoni tal-Komponent 1 u Direzzjoni tal-Komponent 2 bejn FCs**

| Nru | Kamp                                                                | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|-----|---------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 6   | Settur korporattiv tal-kontroparti 1                                | CDTI                 | <pre> &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lg1&gt;       &lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lg1&gt;   &lt;/IdTp&gt;   &lt;Ntr&gt;     &lt;FI&gt;&lt;Sctr&gt;&lt;Cd&gt;CDTI&lt;/Cd&gt;     &lt;/Sctr&gt;&lt;ClrThrshld&gt;true     &lt;/ClrThrshld&gt;&lt;/FI&gt;   &lt;/Ntr&gt;   &lt;RptOblgtn&gt;true   &lt;/RptOblgtn&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2021-03-17T15:17:00Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; </pre> |
| 7   | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1                              | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 8   | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2                             | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 9   | Kontroparti 2                                                       | ABCDEFGHIJKLMNOPQRST |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 10  | Pajjiż tal-kontroparti 2                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 11  | Natura tal-kontroparti 2                                            | F                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 12  | Settur korporattiv tal-kontroparti 2                                | CDTI                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 13  | Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 2                              | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 14  | Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2                             | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 15  | ID tas-sensar                                                       |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 16  | Membru tal-ikklerjar                                                |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 17  | Direzzjoni                                                          | -                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 18  | Direzzjoni tal-komponent 1                                          | MAKE                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 19  | Direzzjoni tal-komponent 2                                          | TAKE                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 20  | B'rabta diretta ma' attività kummerċjali jew finanzjament tat-teżor |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 5.2 Tabella 2 Data komuni

500. Wara l-mili tal-kampijiet tad-*data* dwar il-kontroparti, jiġi inkluż il-mili tal-kampijiet tad-*data* komuni għal każijiet ta' użu differenti. Ir-rapportar f'konformità mal-iskemi XML tal-ISO 20022 huwa pprovdut ukoll.

501. Kull subtaqsima tinkludi deskrizzjoni qasira tal-loġika tar-rapportar għall-kampijiet rilevanti.

### 5.2.1 Ir-rapportar tat-tipi ta' azzjoni fil-livell tan-negozju u fil-livell tal-pożizzjoni

502. Din is-subtaqsima turi l-mili tal-kampijiet rilevanti biex jiġu rrapportati l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja.

#### 5.2.1.1 Derivattiv bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li ma ġiex ikklerjat

503. It-Tabella 49 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' derivattiv ġdid, li mhuwiex ikklerjat. Dan huwa l-mod kif id-derivattivi bilaterali għandhom jiġu rrapportati, fil-livell tan-negozju.

| Tabella 49 - Derivattiv ġdid fil-livell tan-negozju li ma ġiex ikklerjat |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                      | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.1                                                                      | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;New&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;NonClrd&gt;       &lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;     &lt;/NonClrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 2.31                                                                     | Ikklerjat       | LE      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.151                                                                    | Tip ta' azzjoni | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.152                                                                    | Tip ta' event   | TRAD    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.154                                                                    | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

#### 5.2.1.2 Derivattiv bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li jiġi kklerjat fl-istess ġurnata jew wara

504. It-Tabella 50, it-Tabella 51 u t-Tabella 52 juru l-mili tal-kampijiet tar-rapportar minn kontroparti fil-każ li derivattiv ġdid jiġi konkluż b'mod bilaterali u jiġi kklerjat wara fl-istess ġurnata jew wara. Il-kontropartijiet għandhom jipprezentaw rapport tad-derivattiv bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Ikklerjar" biex jindikaw it-terminazzjoni tan-negozju rrapportat bħala mhux ikklerjat. Wara dan, il-kontroparti għandha tippreżenta rapport tad-derivattiv bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u bit-tip ta' event "Ikklerjar" biex tindika li d-derivattiv ikun ġie kklerjat. Il-kontroparti għandha ttipprovdi "UTI preċedenti" f'dan l-aħħar rapport. Is-sekwenza tas-sottomissjonijiet hija murija fit-tabelli ta' hawn taħt.

| Tabella 50 - Derivattiv bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li ġie kklerjat fl-istess ġurnata jew wara |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                       | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.1                                                                                                       | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;New&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;NonClrd&gt;       &lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;     &lt;/NonClrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 2.31                                                                                                      | Ikklerjat       | LE      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.151                                                                                                     | Tip ta' azzjoni | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.152                                                                                                     | Tip ta' event   | TRAD    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.154                                                                                                     | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

| Tabella 51 - Terminazzjoni tad-derivattiv bilaterali fil-livell tan-negozju minħabba l-ikklerjar fl-istess ġurnata jew wara |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                         | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 2.1                                                                                                                         | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;Termntn&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;CLRG&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Termntn&gt; </pre> |
| 2.151                                                                                                                       | Tip ta' azzjoni | TERM    |                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 2.152                                                                                                                       | Tip ta' event   | CLRG    |                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 2.154                                                                                                                       | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                              |

| Tabella 52 - Derivattiv ikklerjat ġdid fil-livell tan-negozju li jirriżulta mill-ikklerjar ta' derivattiv bilaterali fl-istess ġurnata jew wara |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                                             | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.1                                                                                                                                             | UTI             | UTI2    | <pre> &lt;New&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI2     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;PrrTxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/PrrTxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;CLRG&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;Clrd&gt;       ... </pre> |
| 2.3                                                                                                                                             | UTI preċedenti  | UTI1    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.31                                                                                                                                            | Ikklerjat       | IVA     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.151                                                                                                                                           | Tip ta' azzjoni | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.152                                                                                                                                           | Tip ta' event   | CLRG    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.154                                                                                                                                           | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

**Tabella 52 - Derivattiv ikklerjat ġdid fil-livell tan-negozju li jirriżulta mill-ikklerjar ta' derivattiv bilaterali fl-istess ġurnata jew wara**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                              |
|-----|------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |         | <pre> &lt;/ClrD&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |

505. Innota li r-rapport tat-Tabella 50 u tat-Tabella 51 mhuwiex mistenni jekk in-negozju jkun konkluz f'centru tan-negozjar u kklerjat minn CCP fl-istess ġurnata, ir-rapport tat-Tabella 52 biss huwa mistenni f'tali każ (mingħajr il-kamp "UTI preċedenti"). Barra minn hekk, it-Tabella 52 turi r-rapportar fil-każ li fih derivattiv ikklerjat ma jiġix inkluż immedjatament f'pożizzjoni (f'liema każ jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni POSC kif iċċarat fl-eżempji sussegwenti).

#### 5.2.1.3 Derivattiv bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li jiġi kklerjat fl-istess ġurnata jew wara u immedjatament inkluż fil-pożizzjoni

506. It-Tabelli 53, 54, 55 u 56 juru l-mili tal-kampijiet tar-rapportar minn kontroparti fil-każ li derivattiv ġdid jiġi konkluz b'mod bilaterali, jiġi kklerjat wara fl-istess ġurnata jew wara u immedjatament inkluż f'pożizzjoni. Il-kontropartijiet għandhom jipprezentaw rapport tad-derivattiv bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni" u bit-tip ta' event "Ikklerjar" biex jindikaw it-terminazzjoni tan-negozju li huwa kklerjat. Sussegwentement, għandhom jirrapportaw dak id-derivattiv ikklerjat, li huwa immedjatament inkluż f'pożizzjoni, bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni". Fil-kuntest tal-eżempji għal derivattivi fil-livell tal-pożizzjoni, dawn huma identifikati b'Identifikatur Uniku tat-Tranżazzjoni (UTI) tal-pożizzjoni, "PUTI1". UTI tal-pożizzjoni għandu jiġi wkoll rrapportat fil-kamp "UTI tal-pożizzjoni sussegwenti" fid-derivattiv fil-livell tan-negozju li jiġi inkluż fil-pożizzjoni sabiex ir-rapporti jkun jistgħu jintrabtu. Wara dan, il-kontroparti għandha tippreżenta rapport tad-derivattiv bit-tip ta' azzjoni "Modifika" biex tindika li d-derivattiv rispettiv fil-livell tal-pożizzjoni ġie aġġornat minhabba inklużjoni ta' negozju. Is-sekwenza tas-sottomissjonijiet hija murija fit-tabelli ta' hawn taħt.

**Tabella 53 - Derivattiv bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li jiġi kklerjat fl-istess ġurnata jew wara**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                  |
|-----|------|---------|------------------------------|
| 2.1 | UTI  | UTI1    | <pre> &lt;New&gt; ... </pre> |

| Tabella 53 - Derivattivi bilaterali ġdid fil-livell tan-negozju li jiġi kklerjat fl-istess ġurnata jew wara |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                         | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 2.31                                                                                                        | Ikklerjat       | LE      | <pre> &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxId&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxId&gt;     &lt;/TxId&gt;   ...   &lt;DerivEvt&gt;     &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt;   &lt;/DerivEvt&gt;   ...   &lt;TradClr&gt;     &lt;ClrSts&gt;       &lt;NonClr&gt;         &lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;       &lt;/NonClr&gt;     &lt;/ClrSts&gt;   &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 2.151                                                                                                       | Tip ta' azzjoni | NEWT    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 2.152                                                                                                       | Tip ta' event   | TRAD    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 2.154                                                                                                       | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

| Tabella 54 - Terminazzjoni tad-derivattivi bilaterali fil-livell tan-negozju minhabba l-ikklerjar fl-istess ġurnata jew wara |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                          | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.1                                                                                                                          | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;Termntn&gt;   ...   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxId&gt;         UTI1       &lt;/UnqTxId&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;CLRG&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...   &lt;/TxData&gt;   ... </pre> |
| 2.151                                                                                                                        | Tip ta' azzjoni | TERM    |                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.152                                                                                                                        | Tip ta' event   | CLRG    |                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.154                                                                                                                        | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                     |

| Tabella 54 - Terminazzjoni tad-derivattiv bilateral fil-livell tan-negożju minħabba l-ikklerjar fl-istess ġurnata jew wara |      |         |                                                         |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|---------|---------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                        | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                             |
|                                                                                                                            |      |         | <pre>&lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Termntn&gt;</pre> |

| TABELLA 55- DERIVATTIV IKKLERJAT ĠDID LI JIĠI INKLUŻ IMMEDIJATAMENT F'POŻIZZJONI |                                |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                              | Kamp                           | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 2.1                                                                              | UTI                            | UTI2    | <pre>&lt;PosCmpnt&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI2     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;PrrTxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/PrrTxId&gt;   &lt;SbsqntTxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/SbsqntTxId&gt; ...   &lt;TradClr&gt;     &lt;ClrSts&gt;       &lt;Clrd&gt;         ...       &lt;/Clrd&gt;     &lt;/ClrSts&gt;   &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/PosCmpnt&gt;</pre> |
| 2.3                                                                              | UTI preċedenti                 | UTI 1   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.4                                                                              | UTI tal-pożizzjoni sussegwenti | PUTI1   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.31                                                                             | Ikklerjat                      | IVA     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.151                                                                            | Tip ta' azzjoni                | POSC    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.152                                                                            | Tip ta' event                  |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.154                                                                            | Livell                         | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

**Tabella 56 – Modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni li tirriżulta mill-inklużjoni ta' negozju**

| Nru   | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------|-----------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.1   | UTI             | PUTI1   | <pre> &lt;Mod&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;INCP&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; ...    &lt;TradClr&gt;     &lt;ClrSts&gt;       &lt;Clrd&gt;         ...       &lt;/Clrd&gt;     &lt;/ClrSts&gt;   &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;PSTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Mod&gt; </pre> |
| 2.31  | Ikklerjat       | IVA     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni | MODI    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.152 | Tip ta' event   | INCP    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 2.154 | Livell          | PSTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

#### 5.2.1.4 Derivattiv ġdid konkluz f'centru tan-negozjar u kklerjat fl-istess ġurnata, rapportat b'ħala komponent ta' pożizzjoni

507. It-Tabella 57 u t-Tabella 58 juru l-mili tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ ta' derivattiv ġdid li jiġi konkluz f'centru tan-negozjar jew f'pjattaforma tan-negozjar organizzata u kklerjat minn kontroparti ċentrali fl-istess ġurnata kif ukoll inkluż f'pożizzjoni f'dik l-istess ġurnata. B'mod partikolari, id-derivattiv fil-forma kklerjata tiegħu biss għandu jiġi rapportat. Fil-kuntest tal-eżempji għal derivattivi fil-livell tal-pożizzjoni, dawn jiġu identifikati b'Identifikatur Uniku tat-Tranzazzjoni (UTI) tal-pożizzjoni, "PUTI1". UTI tal-pożizzjoni għandu jiġi wkoll rapportat fil-kamp "UTI tal-pożizzjoni sussegwenti" fid-derivattiv fil-livell tan-negozju li jiġi inkluż fil-pożizzjoni sabiex ir-rapporti jkunu jistgħu jintrabtu.

**Tabella 57 - Derivattiv ġdid konkluz f'ċentru tan-negożjar u kklerjat minn CCP fl-istess ġurnata u rapportat bil-komponent ta' pożizzjoni fil-livell tan-negożju**

| Nru   | Kamp                           | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------|--------------------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.1   | UTI                            | UTI1    | <pre> &lt;PosCmpnt&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;SbsqntTxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI2     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/SbsqntTxId&gt; ... &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;Clrd&gt;       ...     &lt;/Clrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/PosCmpnt&gt; </pre> |
| 2.4   | UTI tal-pożizzjoni sussegwenti | PUTI2   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.31  | Ikklerjat                      | IVA     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni                | POSC    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.152 | Tip ta' event                  |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.154 | Livell                         | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

**Tabella 58 - Derivattiv ġdid rapportat fil-livell tal-pożizzjoni**

| Nru   | Kamp            | Eżempju            | Messaġġ XML                                                                                                                           |
|-------|-----------------|--------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.1   | UTI             | PUTI2              | <pre> &lt;New&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI2     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... </pre> |
| 2.31  | Ikklerjat       | IVA                |                                                                                                                                       |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni | NEWT <sup>25</sup> |                                                                                                                                       |
| 2.152 | Tip ta' event   | INCP               |                                                                                                                                       |

<sup>25</sup> F'dan l-eżempju tinholoq pożizzjoni ġdida. Fil-każ fejn tranżazzjoni kklerjata tkun inkluża f'pożizzjoni eżistenti, din tkun irrapportata b'halha modifika ta' dik il-pożizzjoni (bit-tip ta' azzjoni MODI) b'hal fl-eżempju...

| Tabella 58 - Derivattiv ġdid rapportat fil-livell tal-pożizzjoni |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------------------------------------------------------------|--------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                              | Kamp   | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 2.154                                                            | Livell | PSTN    | <pre> &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;INCP&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt;  ... &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;     &lt;Clrd&gt;        ...     &lt;/Clrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxData&gt;  ... &lt;Lv1&gt;PSTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |

#### 5.2.1.5 Modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni minħabba l-inkluzjoni ta' derivattiv ġdid fil-pożizzjoni

508. Dan l-eżempju juri l-mod kif għandha tiġi rapportata modifika ta' pożizzjoni meta derivattiv ġdid fil-livell tan-negozju jiġi inkluz f'dik il-pożizzjoni.

| Tabella 59 - Modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.1                                                            | UTI             | PUTI1   | <pre> &lt;Mod&gt;  ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;  ...   &lt;DerivEvt&gt;     &lt;Tp&gt;INCP&lt;/Tp&gt;   &lt;/DerivEvt&gt;  ... &lt;/TxData&gt;  ... &lt;Lv1&gt;PSTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Mod&gt; </pre> |
| 2.151                                                          | Tip ta' azzjoni | MODI    |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 2.152                                                          | Tip ta' event   | INCP    |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 2.154                                                          | Livell          | PSTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

#### 5.2.1.6 Modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni minħabba diversi avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja

509. Dan l-eżempju juri l-mod kif tiġi rapportata modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni, meta l-pożizzjoni tiġi affettwata minn diversi avvenimenti matul il-ġurnata u mhuwiex possibbli li jiġi speċifikat it-tip ta' event li minħabba fih seħħet il-modifika.

| Tabella 60 - Modifika ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni |                 |         |                                                                                                                                                                                                    |
|----------------------------------------------------------------|-----------------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                        |
| 2.1                                                            | UTI             | PUTI1   | <pre> &lt;Mod&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       PUTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;PSTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Mod&gt; </pre> |
| 2.151                                                          | Tip ta' azzjoni | MODI    |                                                                                                                                                                                                    |
| 2.152                                                          | Tip ta' event   |         |                                                                                                                                                                                                    |
| 2.154                                                          | Livell          | PSTN    |                                                                                                                                                                                                    |

#### 5.2.1.7 Modifika ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

510. It-Tabella 61 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ li derivattiv rapportat preċedentement fil-livell tan-negozju jiġi modifikat wara li l-kontropartijiet jiftiehm u li jemendaw ċerti termini tad-derivattiv.

| Tabella 61 - Modifika ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |                 |         |                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------------------------------------------|-----------------|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                         | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                       |
| 2.1                                                         | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;Mod&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; </pre> |
| 2.151                                                       | Tip ta' azzjoni | MODI    |                                                                                                                                                                                   |
| 2.152                                                       | Tip ta' event   | TRAD    |                                                                                                                                                                                   |
| 2.154                                                       | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                   |

| Tabella 61 - Modifika ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |      |         |                                                                                                 |
|-------------------------------------------------------------|------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                         | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                     |
|                                                             |      |         | <pre> &lt;/DerivEvt&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Mod&gt; </pre> |

#### 5.2.1.8 Korrezzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

511. It-Tabella 62 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm korrezzjoni ta' kampijiet tad-*data* li ġew ippreżentati hażin f'rapport preċedenti ta' derivattiv fil-livell tan-negozju.

| Tabella 62 - Korrezzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |                 |         |                                                                                                                                                                                                         |
|----------------------------------------------------------------|-----------------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                             |
| 2.1                                                            | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;Crrctn&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Crrctn&gt; </pre> |
| 2.151                                                          | Tip ta' azzjoni | CORR    |                                                                                                                                                                                                         |
| 2.152                                                          | Tip ta' event   |         |                                                                                                                                                                                                         |
| 2.154                                                          | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                         |

#### 5.2.1.9 Korrezzjoni tal-valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

512. It-Tabella 63 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm korrezzjoni tal-kampijiet tad-*data* relatati mal-valwazzjoni li ġew ippreżentati hażin f'rapport preċedenti ta' derivattiv fil-livell tan-negozju. Jekk jogħġbok innota li l-mili tal-kampijiet tal-valwazzjoni huwa muri f'eżempju separat fit-taqsimha 5.2.2.3.

| Tabella 63 - Korrezzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |      |         |             |
|----------------------------------------------------------------|------|---------|-------------|
| Nru                                                            | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML |

|       |                 |      |                                                                                                                                                                                                         |
|-------|-----------------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.1   | UTI             | UTI1 | <pre> &lt;Crrctn&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Crrctn&gt; </pre> |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni | CORR |                                                                                                                                                                                                         |
| 2.152 | Tip ta' event   |      |                                                                                                                                                                                                         |
| 2.154 | Livell          | TCTN |                                                                                                                                                                                                         |

#### 5.2.1.10 Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

513. It-Tabella 64 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-kontroparti tippreżenta aġġornament tal-valwazzjoni kuljum għal derivattiv rapportat preċedentement fil-livell tan-negozju. Jekk jogħġbok innota li l-mili tal-kampijiet tal-valwazzjoni huwa muri f'eżempju separat fit-taqsima 5.2.2.3.

| Tabella 64 - Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |                 |         |                                                                                                                                                                                                             |
|----------------------------------------------------------------|-----------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                 |
| 2.1                                                            | UTI             | UTI1    | <pre> &lt;ValtnUpd&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/ValtnUpd&gt; </pre> |
| 2.151                                                          | Tip ta' azzjoni | VALU    |                                                                                                                                                                                                             |
| 2.152                                                          | Tip ta' event   |         |                                                                                                                                                                                                             |
| 2.154                                                          | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                             |

#### 5.2.1.11 Ir-rapportar ta' aġġornament tal-marġni għal derivattiv kollateralizzat fil-livell tan-negozju

514. It-Tabella 65 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-kontroparti tippreżenta aġġornament tal-marġni kuljum għal derivattiv rapportat preċedentement fil-livell

tan-negozju u dak id-derivattiv jiġi kollateralizzat b'mod individwali. Jekk jogħġbok innota li l-mili tal-kampijiet tal-marġni huwa muri f'eżempji separati fit-taqsimi 5.3.

| Tabella 65 - Aġġornament tal-marġni għal derivattiv fil-livell tan-negozju kollateralizzat fil-livell tan-negozju |                                    |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                               | Kamp                               | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.8                                                                                                               | Indikatur tal-portafoll kollateral | FALZ    | <pre> &lt;MrgnUpd&gt;   ...   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;Coll&gt;     &lt;CollPrtflCd&gt;       &lt;Prtfl&gt;         &lt;NoPrtfl&gt;           NOAP         &lt;/NoPrtfl&gt;       &lt;/Prtfl&gt;     &lt;/CollPrtflCd&gt;   ... &lt;/MrgnUpd&gt; </pre> |
| 3.9                                                                                                               | Kodiċi tal-portafoll kollateral    |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 3.10                                                                                                              | UTI                                | UTI1    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 3.28                                                                                                              | Tip ta' azzjoni                    | MARU    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

#### 5.2.1.12 Ir-rapportar ta' aġġornament tal-marġni għal derivattiv kollateralizzat fil-livell tal-portafoll

515. It-Tabella 66 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-kontroparti tippreżenta aġġornament tal-marġni kuljum fil-każ ta' kollateralizzazzjoni fil-livell tal-portafoll. Jekk jogħġbok innota li l-mili tal-kampijiet tal-marġni huwa muri f'eżempji separati fit-taqsimi 5.3.

| Tabella 66 - Aġġornament tal-marġni għal derivattiv fil-livell tan-negozju kollateralizzat fil-livell tal-portafoll |                                    |            |                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                                 | Kamp                               | Eżempju    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                   |
| 3.8                                                                                                                 | Indikatur tal-portafoll kollateral | VERU       | <pre> &lt;MrgnUpd&gt;   ...   &lt;Coll&gt;     &lt;CollPrtflCd&gt;       &lt;Prtfl&gt;         &lt;Cd&gt;           COLLPCODE1         &lt;/Cd&gt;       &lt;/Prtfl&gt;     &lt;/CollPrtflCd&gt;   ... </pre> |
| 3.9                                                                                                                 | Kodiċi tal-portafoll kollateral    | COLLPCODE1 |                                                                                                                                                                                                               |
| 3.10                                                                                                                | UTI                                |            |                                                                                                                                                                                                               |

**Tabella 66 - Aġġornament tal-marġni għal derivattiv fil-livell tan-negozju kollateralizzat fil-livell tal-portafoll**

| Nru  | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML       |
|------|-----------------|---------|-------------------|
| 3.28 | Tip ta' azzjoni | MARU    | ...<br></MrgnUpd> |

#### 5.2.1.13 Korrezzjoni tad-data dwar il-marġni fil-livell tal-portafoll

516. It-Tabella 67 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm korrezzjoni tal-kampijiet tad-data dwar il-marġni li ġew ippreżentati f'rapport preċedenti tal-kollateral fil-livell tal-portafoll.

**Tabella 67 - Korrezzjoni tad-data dwar il-marġni fil-livell tal-portafoll**

| Nru  | Kamp                               | Eżempju    | Messaġġ XML                                                                                                                            |
|------|------------------------------------|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.8  | Indikatur tal-portafoll kollateral | VERU       | <Crrctn><br>...<br><Coll><br><CollPrtf1Cd><br><Prtf1><br><Cd><br>COLLPCODE1<br></Cd><br></Prtf1><br></CollPrtf1Cd><br>...<br></Crrctn> |
| 3.9  | Kodiċi tal-portafoll kollateral    | COLLPCODE1 |                                                                                                                                        |
| 3.10 | UTI                                |            |                                                                                                                                        |
| 3.28 | Tip ta' azzjoni                    | CORR       |                                                                                                                                        |

#### 5.2.1.14 Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

517. It-Tabella 68 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta derivattiv fil-livell tan-negozju jiġi terminat qabel id-data ta' maturità tiegħu wara li l-kontropartijiet jiftiehmu li jitterminaw kmieni (iktar milli minhabba avveniment speċifiku li jirriżulta fit-terminazzjoni ta' derivattiv).

**Tabella 68 - Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tan-negozju**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML      |
|-----|------|---------|------------------|
| 2.1 | UTI  | UTI1    | <Termntn><br>... |

| Tabella 68 - Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                      | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 2.151                                                                    | Tip ta' azzjoni | TERM    | <pre> &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   ...   &lt;DerivEvt&gt;     &lt;Tp&gt;ETRM&lt;/Tp&gt;   &lt;/DerivEvt&gt;   ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Termntn&gt; </pre> |
| 2.152                                                                    | Tip ta' event   | ETRM    |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.154                                                                    | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                    |

#### 5.2.1.15 Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni

518. It-Tabella 69 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni jiġi terminat qabel id-data ta' maturità tiegħu wara li l-kontropartijiet jiftiehm u li jitterminaw kmieni (iktar milli minhabba avveniment speċifiku li jirriżulta fit-terminazzjoni ta' derivattiv). Dan jista' jseħh, pereżempju, meta l-pożizzjoni tiġi nnettjata għal żero u l-kontropartijiet jippreferu jagħlqu l-pożizzjoni iktar milli jkomplu jirrapportaw il-valwazzjoni kuljum.

| Tabella 69 - Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni |                 |         |                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------|-----------------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                         | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.1                                                                         | UTI             | PUTI1   | <pre> &lt;Termntn&gt;   ...   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         PUTI1       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;ETRM&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ...   &lt;/TxData&gt;   ... </pre> |
| 2.151                                                                       | Tip ta' azzjoni | TERM    |                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 2.152                                                                       | Tip ta' event   | ETRM    |                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 2.154                                                                       | Livell          | PSTN    |                                                                                                                                                                                                                                                                        |

**Tabella 69 - Terminazzjoni bikrija ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                             |
|-----|------|---------|---------------------------------------------------------|
|     |      |         | <pre>&lt;Lv1&gt;PSTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Termntn&gt;</pre> |

#### 5.2.1.16 Żball ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

519. It-Tabella 70 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' kancellazzjoni ta' rapport sħiħ ipprezentat ħażin fejn id-derivattiv qatt ma jkun seħħ jew ma kienx soġġett għall-obbligi ta' rapportar skont l-EMIR, iżda li kien għe rapportat lil TR bi żball.

**Tabella 70 - Żball ta' derivattiv fil-livell tan-negozju**

| Nru   | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                     |
|-------|-----------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.1   | UTI             | UTI1    | <pre>&lt;Err&gt; ... &lt;TxData&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/TxId&gt; ... &lt;/TxData&gt; ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Err&gt;</pre> |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni | EROR    |                                                                                                                                                                                                 |
| 2.152 | Tip ta' event   |         |                                                                                                                                                                                                 |
| 2.154 | Livell          | TCTN    |                                                                                                                                                                                                 |

#### 5.2.1.17 Ftuħ mill-ġdid ta' derivattiv fil-livell tan-negozju

520. It-Tabella 71 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ li fih derivattiv li kien terminat jew sar żball fuqu bi żball jinfetaħ mill-ġdid.

**Tabella 71 - Ftuħ mill-ġdid ta' derivattiv fil-livell tan-negozju**

| Nru   | Kamp            | Eżempju | Messaġġ XML                                |
|-------|-----------------|---------|--------------------------------------------|
| 2.1   | UTI             | UTI1    | <pre>&lt;Revi&gt; ... &lt;TxData&gt;</pre> |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni | REVI    |                                            |

| Tabella 71 - Ftuħ mill-ġdid ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |               |         |                                                                                                                                                             |
|-------------------------------------------------------------------|---------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                               | Kamp          | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                 |
| 2.152                                                             | Tip ta' event |         | <pre> &lt;TxId&gt;   &lt;UnqTxIdr&gt;     UTI1   &lt;/UnqTxIdr&gt; &lt;/TxId&gt;  ... &lt;/TxData&gt;  ... &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Revi&gt; </pre> |
| 2.154                                                             | Livell        | TCTN    |                                                                                                                                                             |

## 5.2.2 Dettalji rapportabbli oħra

### 5.2.2.1 Rapportar ta' negozju kklerjat / mhux ikklerjat

#### 5.2.2.1.1 Negozju kklerjat f'mudell ta' offerta miftuħa

521. Meta negozju jkun ikklerjat f'mudell ta' offerta miftuħa, l-ikklerjar iseħħ fl-istess ħin tal-konklużjoni tan-negozju. Għalhekk, il-kronogramma tal-eżekuzzjoni u l-kronogramma tal-ikklerjar huma mistennija li jkunu l-istess.

522. It-Tabella ta' hawn taħt turi l-mili tal-kampijiet tat-Tabella 2 tas-sitwazzjoni msemmija hawn fuq mill-perspettiva tas-CCP (bil-LEI BBBBBBBBBBBB1111111111) u tal-Kontroparti 1, peress li f'dan il-każ, hija identika.

523. Il-grupp li ġej ta' kampijiet tar-rapportar għandu jiġi rapportat:

"Ikklerjat" (kamp 2.5) timtela b'"Iva";

"Kronogramma tal-ikklerjar" (kamp 2.32) huwa l-istess b'hal-kamp "Kronogramma tal-eżekuzzjoni" (kamp 2.42);

"Kontroparti ċentrali" (kamp 2.33) timtela bil-LEI tas-CCP.

| Tabella 72 - Negozju kklerjat f'mudell ta' offerta miftuħa |           |         |                                                    |
|------------------------------------------------------------|-----------|---------|----------------------------------------------------|
| Punt                                                       | Kamp      | Eżempju | Messaġġ XML                                        |
| 31                                                         | Ikklerjat | IVA     | <pre> &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt; </pre> |

**Tabella 72 - Negożju kklerjat f'mudell ta' offerta miftuħa**

| Punt | Kamp                            | Eżempju                                                | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|---------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 32   | Kronogramma tal-ikklerjar       | 2021-03-17T15:17:00Z                                   | <pre> &lt;ExctnTmStmp&gt; 2021-03-17T15:17:00Z &lt;/ExctnTmStmp&gt; &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;     CCP Clearing Conditions   &lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;TradClr&gt;   &lt;ClrSts&gt;&lt;Clrd&gt;     &lt;Dtls&gt;       &lt;CCP&gt;         &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB         1111111111       &lt;/LEI&gt;       &lt;/CCP&gt;       &lt;ClrDtTm&gt;2021-03-         17T15:17:00Z       &lt;/ClrDtTm&gt;     &lt;/Dtls&gt;&lt;/Clrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; &lt;/TxDate&gt; &lt;/CmonTradData&gt; </pre> |
| 33   | Kontroparti ċentrali            | BBBBBBBBBB1111111111                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 34   | Tip ta' Ftehim Prinċipali       | OTHR                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 35   | Tip ieħor ta' ftehim prinċipali | Ikklerjar minn kontroparti ċentrali<br>Kondizzjonijiet |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 43   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni     | 2021-03-17T15:17:00Z                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

#### 5.2.2.1.2 Negożju kklerjat f'mudell ta' novazzjoni.

524. Meta derivattiv jkun ikklerjat f'mudell ta' novazzjoni, l-ikklerjar iseħħ wara l-ħin tal-konklużjoni tan-negożju.

525. It-tabella ta' hawn taht turi l-mili tal-kampijiet, mill-perspettiva tas-CCP u tas-CP1, meta derivattiv jiġi kklerjat mis-CCP f'mudell ta' novazzjoni.

526. F'dan ir-rigward, il-grupp li ġej ta' kampijiet ta' rapportar għandu jiġi rapportat: "UTI preċedenti" (kamp 2.3) għandu jiġi rapportat bil-UTI preċedenti (dak tad-derivattiv bilaterali originali fil-każ tad-derivattivi kklerjati mis-CCP);

"Ikklerjat" (kamp 2.31) timtela b'"Iva";

Il-ħin tal-"kronogramma tal-ikklerjar" (kamp 2.32) huwa wara l-ħin ipprovdut fil-kamp "Kronogramma tal-eżekuzzjoni" (kamp 2.42);

"Kontroparti ċentrali" (kamp 2.33) timtela bil-LEI tas-CCP.

| Tabella 73 - Derivattiv ikklerjat f'mudell ta' novazzjoni |                                 |                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----------------------------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Punt                                                      | Kamp                            | Eżempju                                                | Messagg XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 1                                                         | UTI                             | UTI2                                                   | <pre> &lt;New&gt; ... &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxDate&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;PrrTxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/PrrTxId&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;       2021-03-17T15:17:00Z     &lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;       &lt;Tp&gt;         &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;       &lt;/Tp&gt;       &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;         CCP Clearing Conditions       &lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;     &lt;/MstrAgrmt&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;CLRG&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     &lt;TradClr&gt;       &lt;ClrSts&gt;&lt;Clrd&gt; </pre> |
| 3                                                         | UTI preċedenti                  | UTI1                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 31                                                        | Ikklerjat                       | IVA                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 32                                                        | Kronogramma tal-ikklerjar       | 2021-03-18T18:00:00Z                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 33                                                        | Kontroparti ċentrali            | BBBBBBBBBB1111111111                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 34                                                        | Tip ta' Ftehim Prinċipali       | OTHR                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 35                                                        | Tip ieħor ta' ftehim prinċipali | Ikklerjar minn kontroparti ċentrali<br>Kondizzjonijiet |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

**Tabella 73 - Derivattiv ikklerjat f'mudell ta' novazzjoni**

| Punt | Kamp                        | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------|-----------------------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 43   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni | 2021-03-17T15:17:00Z | <pre> &lt;DtIs&gt; &lt;CCP&gt;   &lt;LEI     BBBBBBBBBB1111111111   &lt;/LEI&gt; &lt;/CCP&gt; &lt;ClrDtTm&gt;   2021-03-18T18:00:00Z &lt;/ClrDtTm&gt; &lt;/DtIs&gt;&lt;/Clr&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;/TradClr&gt; ... &lt;/TxDate&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/New&gt; </pre> |
| 151  | Tip ta' azzjoni             | NEWT                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 152  | Tip ta' event               | CLRG                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                |

**Tabella 74 - Terminazzjoni ta' derivattiv preċedenti (negozzju alfa) f'mudell ta' novazzjoni**

| Punt | Kamp                       | Eżempju    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|------|----------------------------|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1    | UTI                        | UTI1       | <pre> &lt;Termntn&gt; ... &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         UTI1       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;EarlyTermntnDt&gt;       2021-03-18     &lt;/EarlyTermntnDt&gt;     ...     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;CLRG&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     ... </pre> |
| 45   | Data terminazzjoni bikrija | 2021-03-18 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 151  | Tip ta' azzjoni            | TERM       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 152  | Tip ta' event              | CLRG       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

**Tabella 74 - Terminazzjoni ta' derivattiv preċedenti (negozzju alfa) f'mudell ta' novazzjoni**

| Punt | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                         |
|------|------|---------|---------------------------------------------------------------------|
|      |      |         | <pre> &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/Termntn&gt; </pre> |

#### 5.2.2.1.3 Negozzju mhux ikklerjat

527. Il-kamp "Ikklerjat" (kamp 2.31) jimtela b"LE". Il-bqija tal-kampijiet relatati mal-ikklerjar ma jimtlewx.

**Tabella 75 - Negozzju mhux ikklerjat**

| Nru | Kamp                        | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|-----------------------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | UTI                         | UTI1                 | <pre> &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         UTI1       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;       2021-03-17T15:17:00Z     &lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;TradClr&gt;       &lt;ClrSts&gt;         &lt;NonClrd&gt;           &lt;Rsn&gt;NORE&lt;/Rsn&gt;         &lt;/NonClrd&gt;       &lt;/ClrSts&gt;     &lt;/TradClr&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; </pre> |
| 2   | Numru intraċċar rapport     | tal-tar-             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 31  | Ikklerjat                   | LE                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 32  | Kronogramma tal-ikklerjar   |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 33  | Ċentrali kontroparti        |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 43  | Kronogramma tal-eżekuzzjoni | 2021-03-17T15:17:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

#### 5.2.2.2 Ċentru tan-negożjar

528. Il-kamp “Ċentru tan-negożjar” (kamp 2.41) għandu jimtela f’konformità mat-tip ta’ konklużjoni tad-derivattiv.
529. Il-kontropartijiet għandhom jużaw I-MIC ta’ segment tal-ISO 10383 għad-derivattivi mwettqa f’ċentru tan-negożjar, I-Internalizzatur Sistematiċu (SI) jew pjattaforma tan-negożjar organizzata barra mill-Unjoni. Jekk I-MIC ta’ segment ma jeżistix, għandhom jużaw I-MIC operattiv.
530. Il-kontropartijiet għandhom jużaw il-kodiċi MIC “XOFF” għall-istrumenti finanzjarji ammessi għan-negożju jew negożjati f’ċentru tan-negożjar jew li għalihom tkun saret talba għall-ammissjoni, meta d-derivattiv fuq dak l-istrument finanzjarju ma jitwettaqx f’ċentru tan-negożjar, SI jew pjattaforma tan-negożjar organizzata barra mill-Unjoni, jew jekk kontroparti ma tkunx taf li qed tinnegożja ma’ kontroparti 2 li qed taġixxi bħala SI.
531. Il-kontropartijiet għandhom jużaw il-kodiċi MIC “XXXX” għall-istrumenti finanzjarji li mhumiex ammessi għan-negożjar jew li huma negożjati f’ċentru tan-negożjar jew li għalihom ma saret l-ebda talba għall-ammissjoni u li mhumiex negożjati fuq pjattaforma tan-negożjar organizzata barra mill-Unjoni.

##### 5.2.2.2.1 Eżempju ta’ żewġ SIs li jiffaċċjaw lil xulxin

532. Żewġ kontropartijiet, A u B, li huma t-tnejn SIs, jinnegożjaw ma’ xulxin. Għal dan id-derivattiv, il-kontroparti A taġixxi fil-kapaċità ta’ SI, għalhekk iż-żewġ entitajiet għandhom jirrapportaw I-MIC ta’ dik il-kontroparti fil-kamp taċ-ċentru.
533. Il-kontroparti A hija identifikata bil-LEI 12345678901234500000 u bil-MIC 1234.
534. Il-kontroparti B hija identifikata bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST u bil-MIC ABCD.

**Tabella 76 - Rapportar taċ-ċentru tan-negożjar mill-perspettiva tal-kontroparti A**

| Punt | Kamp                   | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4    | Kontroparti 1          | 12345678901234500000 | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt; </pre> |
| 9    | Kontroparti 2          | ABCDEFGHIJKLMNQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 41   | Ċentru tal-eżekuzzjoni | 1234                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

**Tabella 76 - Rapportar taċ-ċentru tan-negozjar mill-perspettiva tal-kontroparti A**

| Punt | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------|------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |      |         | <pre> &lt;IdTp&gt;   &lt;Lgl&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/Lgl&gt; &lt;/IdTp&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; ... &lt;/CtrPty&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     ...     &lt;PltfmId&gt;1234&lt;/PltfmId&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; </pre> |

**Tabella 77 - Rapportar taċ-ċentru tan-negozjar mill-perspettiva tal-kontroparti B**

| Punt | Kamp                   | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4    | Kontroparti 1          | ABCDEFGHIJKLMNQRST   | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               ABCDEFGHIJKLMNOPQRST             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt; </pre> |
| 9    | Kontroparti 2          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 41   | Ċentru tal-eżekuzzjoni | 1234                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

**Tabella 77 - Rapportar taċ-ċentru tan-negozjar mill-perspettiva tal-kontroparti B**

| Punt | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |      |         | <pre> &lt;IdTp&gt;   &lt;Lgl&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/Lgl&gt; &lt;/IdTp&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; ... &lt;/CtrPty&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     ...     &lt;PltfrmId&gt;1234&lt;/PltfrmId&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; </pre> |

#### 5.2.2.2.2 Eżempju ta' derivattiv wara l-Brexit imwettaq f'suq regolat tar-Renju Unit

535. Derivattivi mwettqa fis-swieq regolati tar-Renju Unit qabel il-Brexit jitqiesu ETD.

536. Min-naħa l-oħra, derivattivi mwettqa fis-swieq regolati tar-Renju Unit wara l-Brexit jitqiesu OTC. Il-kamp "Ċentru tal-eżekuzzjoni" xorta waħda għandu jimtela bil-kodiċi MIC korrispondenti. Madankollu, ikollu effett fuq kampijiet oħra bħall-kamp "Intragrupp" u "Obbligu tal-ikklerjar" li huma meħtieġa għad-derivattivi OTC.

**Tabella 78 - Derivattiv imwettaq qabel il-Brexit**

| Punt | Kamp                        | Eżempju  | Messaġġ XML                                                                                                                                         |
|------|-----------------------------|----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 41   | Ċentru tal-eżekuzzjoni      | XLON     | <pre> &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     ...     &lt;PltfrmId&gt;XLON&lt;/PltfrmId&gt;   &lt;ExctnTmStmp&gt;     2020-12-31T17:00:00Z </pre> |
| 43   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni | 2020-12- |                                                                                                                                                     |

**Tabella 78 - Derivattiv imwettaq qabel il-Brexit**

| Punt | Kamp              | Eżempju      | Messaġġ XML                                           |
|------|-------------------|--------------|-------------------------------------------------------|
|      |                   | 31T17:00:00Z | </ExctnTmStmp><br>...<br></TxData><br></CmonTradData> |
| 30   | Ikklerjar obbligu |              |                                                       |
| 37   | Intragrupp        |              |                                                       |

**Tabella 79 - Derivattiv imwettaq wara l-Brexit**

| Punt | Kamp                        | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 41   | Ċentru tal-eżekuzzjoni      | XLON                 | <CmonTradData><br><TxData><br>...<br><PltfmId>XLON</PltfmId><br><ExctnTmStmp><br>2021-01-04T15:00:00Z<br></ExctnTmStmp><br>...<br><TradClr><br><ClrOblgtn>>false<br></ClrOblgtn><br><IntraGrp>>false</IntraGrp><br></TradClr><br>...<br></TxData><br></CmonTradData> |
| 43   | Kronogramma tal-eżekuzzjoni | 2021-01-04T15:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 30   | Ikklerjar obbligu           | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 37   | Intragrupp                  | FALZ                 |                                                                                                                                                                                                                                                                      |

### 5.2.2.3 Rapportar tal-valwazzjonijiet

537. It-Tabella 80 turi l-mili tad-data tal-valwazzjoni meta l-kontroparti tippreżenta aġġornament tal-valwazzjoni kuljum għal derivattiv rapportat preċedentement fil-livell tan-negozju.

#### 5.2.2.3.1 Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negożju

538. F'dan l-eżempju, il-kontroparti A (bil-LEI 12345678901234500000) hija xerrej ta' opzjoni ta' xiri li hija favorevoli u li ngħatat il-valur fil-ġurnata preċedenti ta' EUR 221,100. Peress li d-derivattiv ikkonċernat huwa opzjoni, id-delta hija komputata u mimlija (0.6). Il-kontroparti B (bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) hija l-bejjiegħ.

| Tabella 80 - Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negożju |                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 1.1                                                            | Kronogramma tar-rapportar                  | 2023-05-16T19:15:05Z | <pre> &lt;ValtnUpd&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;IdTp&gt;             &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;               ABCDEFGHIJKLMNOPQRST             &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;           &lt;/IdTp&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;SubmitgAgt&gt;           &lt;LEI&gt;             12345678901234500000           &lt;/LEI&gt;         &lt;/SubmitgAgt&gt;         &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;           &lt;LEI&gt;             12345678901234500000           &lt;/LEI&gt;         &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;/CtrPty&gt;     &lt;Valtn&gt;       &lt;CtrctVal&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           221100&lt;/Amt&gt;         &lt;/CtrctVal&gt;         &lt;TmStmp&gt;           2023-05-15T18:00:00Z         &lt;/TmStmp&gt;         &lt;Tp&gt;MTMA&lt;/Tp&gt;         &lt;Dlta&gt;0.6&lt;/Dlta&gt;       &lt;/Valtn&gt;       &lt;RptgTmStmp&gt;         2023-05-16T19:15:05Z       &lt;/RptgTmStmp&gt;     &lt;/CtrPtySpcfcData&gt;           </pre> |
| 1.2                                                            | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 1.3                                                            | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 1.4                                                            | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.8                                                            | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.9                                                            | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.1                                                            | UTI                                        | UTI1                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.21                                                           | Ammont tal-valwazzjoni                     | 221,100              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.22                                                           | Munita tal-valwazzjoni                     | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.23                                                           | Kronogramma tal-valwazzjoni                | 2023-05-15T18:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.24                                                           | Metodu tal-valwazzjoni                     | MTMA                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 2.25                                                           | Delta                                      | 0.6                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

| Tabella 80 - Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tan-negozju |                 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|----------------------------------------------------------------|-----------------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                            | Kamp            | Eżempju    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.151                                                          | Tip ta' azzjoni | VALU       | <pre> &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;         UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;/TxId&gt;     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;TmStmp&gt;         2023-05-15       &lt;/TmStmp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lvl&gt;&lt;TCTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/ValtnUpd&gt; </pre> |
| 2.153                                                          | Data tal-event  | 2023-05-15 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 2.154                                                          | Livell          | TCTN       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

#### 5.2.2.3.2 Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni

539. It-Tabella 81 turi l-mili tad-*data* tal-valwazzjoni għal pożizzjoni ta' IRS meta l-pożizzjoni tiġi nnettjata għal żero u l-kontropartijiet jiddeċiedu li jżommu l-pożizzjoni miftuħa (u għalhekk jipprezentaw il-valwazzjoni kuljum).

| Tabella 81 - Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni |                                          |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-------------------------------------------------------------------|------------------------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                               | Kamp                                     | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 1.1                                                               | Kronogramma tar-rapportar                | 2023-06-06T20:00:00Z | <pre> &lt;ValtnUpd&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;IdTp&gt;             &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;               ABCDEFGHIJKLMNOPQRST             &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;           &lt;/IdTp&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt; </pre> |
| 1.2                                                               | ID tal-entità li tippreżenta rapport     | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 1.3                                                               | Entità responsabbli mir-rapportar        | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 1.4                                                               | Kontroparti (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

| Tabella 81 - Valwazzjoni ta' derivattiv fil-livell tal-pożizzjoni |                                         |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------|----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                               | Kamp                                    | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.8                                                               | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2 | VERU                 | <pre> &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;Valtn&gt;   &lt;CtrctVal&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;       0     &lt;/Amt&gt;   &lt;/CtrctVal&gt;   &lt;TmStmp&gt;     2023-06-06T20:00:00Z   &lt;/TmStmp&gt;   &lt;Tp&gt;MTMA&lt;/Tp&gt; &lt;/Valtn&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2023-05-16T19:15:05Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;         PUTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;/TxId&gt;       &lt;DerivEvt&gt;         &lt;TmStmp&gt;           2023-06-05         &lt;/TmStmp&gt;       &lt;/DerivEvt&gt;     &lt;/TxData&gt;   &lt;/CmonTradData&gt;   &lt;Lvl&gt;PSTN&lt;/Lvl&gt; &lt;/ValtnUpd&gt; </pre> |
| 2.9                                                               | Kontroparti 2                           | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.1                                                               | UTI                                     | PUTI1                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.21                                                              | Ammont tal-valwazzjoni                  | 0                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.22                                                              | Munita tal-valwazzjoni                  | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.23                                                              | Kronogramma tal-valwazzjoni             | 2023-06-05T19:00:00Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.24                                                              | Metodu tal-valwazzjoni                  | MTMA                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.151                                                             | Tip ta' azzjoni                         | VALU                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.153                                                             | Data tal-event                          | 2023-06-05           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 2.154                                                             | Livell                                  | PSTN                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

#### 5.2.2.4 Rapportar ta' pagamenti oħra

##### 5.2.2.4.1 Rapportar ta' pagament bil-quddiem

540. It-Tabella 82 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-kontroparti A (bil-LEI 12345678901234500000) li tiegħu r-responsabbiltà mir-riskju tagħmel pagament

inizjali lill-kontroparti B (bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) biex tkopri kwalunkwe inadempjenzi futuri u tippreżenta rapport fil-livell tan-negożju.

| Tabella 82 - Rapportar ta' pagament bil-quddiem |                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-------------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                             | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.1                                             | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-03-06T18:20:05Z | <pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;Lgl&gt;             &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;           &lt;/Id&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;               &lt;OthrCtrPty&gt;                 &lt;IdTp&gt;                   &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;                     ABCDEFGHIJKLMNOPQRST                   &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;                 &lt;/IdTp&gt;                   &lt;/OthrCtrPty&gt;                     &lt;SubmitgAgt&gt;                       &lt;LEI&gt;                         12345678901234500000                       &lt;/LEI&gt;                     &lt;/SubmitgAgt&gt;                       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;                         &lt;LEI&gt;                           12345678901234500000                         &lt;/LEI&gt;                       &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;                         &lt;CtrPty&gt;                           &lt;RptgTmStmp&gt;                             2023-03-06T18:20:05Z                           &lt;/RptgTmStmp&gt;                         &lt;/CtrPtySpcfcData&gt;                           &lt;CmonTradData&gt;                             &lt;TxData&gt;                               &lt;TxId&gt;                                 &lt;UnqTradIdr&gt;                                   123456&lt;/UnqTradIdr&gt;                                 &lt;/TxId&gt;                               &lt;/TxData&gt;                             &lt;/CmonTradData&gt;                           &lt;/CtrPty&gt;                         &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;                       &lt;/SubmitgAgt&gt;                     &lt;/LEI&gt;                   &lt;/OthrCtrPty&gt;                 &lt;/IdTp&gt;               &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;           &lt;/CtrPtySpcfcData&gt;         &lt;/New&gt; </pre> |
| 1.2                                             | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1.3                                             | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1.4                                             | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 1.9                                             | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.1                                             | UTI                                        | 123456               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.73                                            | Tip ieħor ta' pagament                     | UFRO                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.74                                            | Ammont ieħor ta' pagament                  | 100,000              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.75                                            | Munita oħra ta' pagament                   | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.76                                            | Data oħra ta' pagament                     | 2021-03-05           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.77                                            | Pagatur ieħor ta' pagament                 | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.78                                            | Riċevitur ieħor ta' pagament               | ABCDEFGHIJKLMNQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.151                                           | Tip ta' azzjoni                            | NEWT                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.152                                           | Tip ta' event                              | TRAD                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

| Tabella 82 - Rapportar ta' pagament bil-quddiem |        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------------------------------------------------|--------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                             | Kamp   | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 2.154                                           | Livell | TCTN    | <pre> &lt;DerivEvt&gt;   &lt;Tp&gt;TRAD&lt;/Tp&gt; &lt;/DerivEvt&gt; &lt;OthrPmt&gt;   &lt;PmtAmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;       100000     &lt;/Amt&gt;   &lt;/PmtAmt&gt;   &lt;PmtTp&gt;     &lt;Tp&gt;UFRO&lt;/Tp&gt;   &lt;/PmtTp&gt;   &lt;PmtDt&gt;     2021-03-05   &lt;/PmtDt&gt;   &lt;PmtPyr&gt;     &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;       12345678901234500000     &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;   &lt;/PmtPyr&gt;   &lt;PmtRcvr&gt;     &lt;Lgl&gt;       &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Lgl&gt;   &lt;/PmtRcvr&gt; &lt;/OthrPmt&gt; ... &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/New&gt; </pre> |

#### 5.2.2.4.2 Rapportar ta' pagament ta' xoljiment

541. It-Tabella 83 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-istess kontroparti A xxolji l-pagament ta' terminazzjoni kollu u tippreżenta rapport fil-livell tan-negozju.

| Tabella 83 - Rapportar ta' pagament ta' xoljiment |                           |                      |                                                                          |
|---------------------------------------------------|---------------------------|----------------------|--------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                               | Kamp                      | Eżempju              | Messaġġ XML                                                              |
| 1.1                                               | Kronogramma tar-rapportar | 2021-03-06T18:20:05Z | <pre> &lt;Termtn&gt;   &lt;CtrPtySpcfcData&gt;     &lt;CtrPty&gt; </pre> |

**Tabella 83 - Rapportar ta' pagament ta' xoljiment**

| Nru   | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-------|--------------------------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.2   | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000 | <pre> &lt;RptgCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;       12345678901234500000     &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;   &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;IdTp&gt;     &lt;Lgl&gt;&lt;Id&gt;&lt;LEI&gt;       ABCDEFGHIJKLMNOPQRST     &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt;   &lt;/IdTp&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;SubmitgAgt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;LEI&gt;     12345678901234500000   &lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;RptgTmStmp&gt;   2023-03-06T18:20:05Z &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;         456789&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;/TxId&gt;     &lt;EarlyTermntnDt&gt;       2021-03-05     &lt;/EarlyTermntnDt&gt;     &lt;DerivEvt&gt;       &lt;Tp&gt;ETRM&lt;/Tp&gt;     &lt;/DerivEvt&gt;     &lt;OthrPmt&gt;       &lt;PmtAmt&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           70000         &lt;/Amt&gt;       &lt;/PmtAmt&gt;     &lt;/OthrPmt&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPty&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/SubmitgAgt&gt; &lt;/LEI&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;/IdTp&gt; &lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt; &lt;/LEI&gt;&lt;/Id&gt;&lt;/Lgl&gt; </pre> |
| 1.3   | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 1.4   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 1.9   | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.1   | UTI                                        | 456789               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.45  | Data tat-terminazzjoni bikrija             | 2021-03-05           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.73  | Tip ieħor ta' pagament                     | UWIN                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.74  | Ammont ieħor ta' pagament                  | 70,000               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.75  | Munita oħra ta' pagament                   | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.76  | Data oħra ta' pagament                     | 2021-03-05           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.77  | Pagatur ieħor ta' pagament                 | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.78  | Riċevitur ieħor ta' pagament               | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.151 | Tip ta' azzjoni                            | TERM                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.152 | Tip ta' event                              | ETRM                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 2.154 | Livell                                     | TCTN                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

**Tabella 83 - Rapportar ta' pagament ta' xoljiment**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |         | <pre> &lt;/Amt&gt; &lt;/PmtAmt&gt; &lt;PmtTp&gt;   &lt;Tp&gt;UWIN&lt;/Tp&gt; &lt;/PmtTp&gt; &lt;PmtDt&gt;   2021-03-05 &lt;/PmtDt&gt; &lt;PmtPyr&gt;   &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;  12345678901234500000   &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt; &lt;/PmtPyr&gt; &lt;PmtRcvr&gt;   &lt;Lgl&gt;   &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;  ABCDEFGHIJKLMNQRST   &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;   &lt;/Lgl&gt;   &lt;/PmtRcvr&gt; &lt;/OthrPmt&gt;  ... &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;Lv1&gt;TCTN&lt;/Lv1&gt; &lt;/Termntn&gt; </pre> |

#### 5.2.2.4.3 Rapportar ta' skambju prinċipali

542. It-Tabella 84 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta jsejnh skambju prinċipali, relatat ma' swap bejn il-muniti.

543. F'dan l-eżempju, il-kontropartijiet A u B ftiehm kuntratt tad-derivattiv OTC, li jispeċifika:

- skambju inizjali tal-munita nozzjonali f'kull munita differenti u t-termini ta' dak il-ħlas lura tal-munita nozzjonali matul il-ħajja tal-iswap;
- skambju ta' pagamenti regolari kkalkolat kontra żewġ rati tal-imghax, denominati f'żewġ muniti differenti.

544. Il-kontroparti A se tħallas EUR 5M u l-kontroparti B se tħallas 4.3M GBP, bħala skambju prinċipali inizjali għal kull wieħed minnhom. Il-kontropartijiet se jiskambjaw il-pagamenti kull 6 xhur għall-IRS miftiehem varjabbli għal varjabbli ta' 3 snin

545. L-iskambju mill-ġdid tal-istess nozzjonali ta' muniti se jsejnh fid-data ta' maturità.

546. It-Tabella ta' hawn taht turi r-rapportar tal-pagamenti ta' skambju prinċipali mill-perspettiva tal-kontroparti A. Il-kontroparti tirrapporta kemm il-pagamenti magħmula kif ukoll riċevuti, fuq id-data ta' skambju inizjali u finali – sakemm dawn il-pagamenti kollha huma magħrufa fil-ħin tar-rapportar.

| Tabella 84 - Rapportar ta' skambji nozzjonali mill-perspettiva tal-Kontroparti A |                                            |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|----------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                              | Kamp                                       | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 1.1                                                                              | Kronogramma tar-rapportar                  | 2021-05-20T18:00:15Z | <pre> &lt;CtrPtySpcfcData&gt;   &lt;CtrPty&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;DrctnOrSd&gt;&lt;Drctn&gt;         &lt;DrctnOfTheFrstLeg&gt;           TAKE         &lt;/DrctnOfTheFrstLeg&gt;         &lt;DrctnOfTheScndLeg&gt;           MAKE         &lt;/DrctnOfTheScndLeg&gt;       &lt;/Drctn&gt;&lt;/DrctnOrSd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               ABCDEFGHIJKLMNOPQRST             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/IdTp&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;SubmitgAgt&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/SubmitgAgt&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;/CtrPty&gt;   &lt;RptgTmStmp&gt;     2021-05-20T18:00:15Z           </pre> |
| 1.2                                                                              | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.3                                                                              | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.4                                                                              | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.9                                                                              | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMNQRST   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.18                                                                             | Direzzjoni tal-komponent 1                 | TAKE                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 1.19                                                                             | Direzzjoni tal-komponent 2                 | MAKE                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2.1                                                                              | UTI                                        | AABB123456           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2.10                                                                             | Tip ta' kuntratt                           | SWAP                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2.42                                                                             | Kronogramma tal-eżekuzzjoni                | 2021-05-19T13:10:25Z |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2.44                                                                             | Data ta' skadenza                          | 2024-05-18           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2.55                                                                             | Ammont nozzjonali tal-komponent 1          | 5,000,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

**Tabella 84 - Rapportar ta' skambji nozzjonali mill-perspettiva tal-Kontroparti A**

| Nru  | Kamp                              | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.56 | Munita nozzjonali 1               | EUR                  | <pre> &lt;/RptgTmStmp&gt; &lt;/CtrPtySpcfcData&gt; &lt;CmonTradData&gt;   &lt;CtrctData&gt;     &lt;CtrctTp&gt;SWAP&lt;/CtrctTp&gt;   &lt;/CtrctData&gt;   &lt;TxData&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;         AABBB123456       &lt;/UnqTradIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     ...     &lt;NtnlAmt&gt;       &lt;FrstLeg&gt;&lt;Amt&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;5000000       &lt;/Amt&gt;&lt;/Amt&gt;&lt;/FrstLeg&gt;       &lt;ScndLeg&gt;&lt;Amt&gt;         &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;4300000       &lt;/Amt&gt;&lt;/Amt&gt;&lt;/ScndLeg&gt;     &lt;/NtnlAmt&gt;     &lt;ExctnTmStmp&gt;       2021-05-19T13:10:25Z     &lt;/ExctnTmStmp&gt;     &lt;XprtnDt&gt;       2024-05-18     &lt;/XprtnDt&gt;     &lt;OthrPmt&gt;       &lt;PmtAmt&gt;         &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;           5000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/PmtAmt&gt;       &lt;PmtTp&gt;         &lt;Tp&gt;PEXH&lt;/Tp&gt;       &lt;/PmtTp&gt;       &lt;PmtDt&gt;         2021-05-20       &lt;/PmtDt&gt;       &lt;PmtPyer&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;LEI&gt;             12345678901234500000           &lt;/LEI&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/PmtPyer&gt;       &lt;PmtRcvr&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;LEI&gt;             ABCDEFGHIJKLMNOPQRST           &lt;/Lgl&gt;         &lt;/PmtRcvr&gt;       &lt;/PmtRcvr&gt;     &lt;/OthrPmt&gt;   &lt;/TxData&gt; &lt;/CmonTradData&gt; &lt;/RptgTmStmp&gt; </pre> |
| 2.64 | Ammont nozzjonali tal-komponent 2 | 4,300,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.65 | Munita nozzjonali tal-komponent 2 | GBP                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.73 | Tip ieħor ta' pagament            | PEXH                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.74 | Ammont ieħor ta' pagament         | 5,000,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.75 | Munita oħra ta' pagament          | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.76 | Data oħra ta' pagament            | 2021-05-20           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.77 | Pagatur ieħor ta' pagament        | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.78 | Riċevitur ieħor ta' pagament      | ABCDEFGHIJKLMNOPQRST |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.73 | Tip ieħor ta' pagament            | PEXH                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.74 | Ammont ieħor ta' pagament         | 4,300,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.75 | Munita oħra ta' pagament          | GBP                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 2.76 | Data oħra ta' pagament            | 2021-05-20           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

| Tabella 84 - Rapportar ta' skambji nozzjonali mill-perspettiva tal-Kontroparti A |                              |                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                              | Kamp                         | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 2.77                                                                             | Pagatur ieħor ta' pagament   | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  | </LEI><br></Lgl><br></PmtRcvr><br></OthrPmt><br><OthrPmt><br><PmtAmt><br><Amt Ccy="GBP"><br>4300000</Amt><br></PmtAmt><br><PmtTp><br><Tp>PEXH</Tp><br></PmtTp><br><PmtDt><br>2021-05-20<br></PmtDt><br><PmtPyer><br><Lgl><br><LEI><br>ABCDEFGHJKLMNOPQRST<br></LEI><br></Lgl><br></PmtPyer><br><PmtRcvr><br><Lgl><br><LEI><br>12345678901234500000<br></LEI><br></Lgl><br></PmtRcvr><br></OthrPmt><br><OthrPmt><br><PmtAmt><br><Amt Ccy="GBP"><br>4300000</Amt><br></PmtAmt><br><PmtTp><br><Tp>PEXH</Tp><br></PmtTp><br><PmtDt><br>2021-05-18<br></PmtDt><br><PmtPyer><br><Lgl><br><LEI><br>12345678901234500000<br></LEI><br></Lgl><br></PmtPyer><br><PmtRcvr><br><Lgl><br><LEI><br>ABCDEFGHJKLMNOPQRST |
| 2.78                                                                             | Riċevitur ieħor ta' pagament | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.73                                                                             | Tip ieħor ta' pagament       | PEXH                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.74                                                                             | Ammont ieħor ta' pagament    | 4,300,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.75                                                                             | Munita oħra ta' pagament     | GBP                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.76                                                                             | Data oħra ta' pagament       | 2024-05-18           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.77                                                                             | Pagatur ieħor ta' pagament   | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.78                                                                             | Riċevitur ieħor ta' pagament | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.73                                                                             | Tip ieħor ta' pagament       | PEXH                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.74                                                                             | Ammont ieħor ta' pagament    | 5,000,000            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.75                                                                             | Munita oħra ta' pagament     | EUR                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.76                                                                             | Data oħra ta' pagament       | 2024-05-18           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.77                                                                             | Pagatur ieħor ta' pagament   | ABCDEFGHJKLMNOPQRST  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 2.78                                                                             | Riċevitur ieħor ta' pagament | 12345678901234500000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

**Tabella 84 - Rapportar ta' skambji nozzjonali mill-perspettiva tal-Kontroparti A**

| Nru | Kamp | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----|------|---------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |         | <pre> &lt;/LEI&gt; &lt;/Lgl&gt; &lt;/PmtRcvr&gt; &lt;/OthrPmt&gt; &lt;OthrPmt&gt;   &lt;PmtAmt&gt;     &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;       5000000&lt;/Amt&gt;     &lt;/PmtAmt&gt;     &lt;PmtTp&gt;       &lt;Tp&gt;PEXH&lt;/Tp&gt;     &lt;/PmtTp&gt;     &lt;PmtDt&gt;       2021-05-18     &lt;/PmtDt&gt;     &lt;PmtPyer&gt;       &lt;Lgl&gt;         &lt;LEI&gt;           ABCDEFGHIJKLMNOPQRST         &lt;/LEI&gt;       &lt;/Lgl&gt;     &lt;/PmtPyer&gt;     &lt;PmtRcvr&gt;       &lt;Lgl&gt;         &lt;LEI&gt;           12345678901234500000         &lt;/LEI&gt;       &lt;/Lgl&gt;     &lt;/PmtRcvr&gt;   &lt;/OthrPmt&gt; </pre> |

### 5.3 Tabella 3 *Data* dwar il-marġni

547. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw it-tipi rilevanti kollha ta' kollateral (marġni inizjali, marġni ta' varjazzjoni u kollateral eċċessiv), u jipprovdu kemm il-valuri ta' qabel kif ukoll ta' wara l-haircut. Kull tip ta' kollateral għandu jiġi rapportat bħala figura unika, li tkun is-somma tal-valuri tal-assi kollha depożitati/riċevuti espressi f'munita unika.
548. Il-kollateral għandu jiġi rapportat fuq bażi tal-portafoll. Huwa f'idejn il-kontroparti li tirrapporta biex tiddetermina liema valur uniku għandu jitpoġġa fil-kamp "Kodiċi tal-Portafoll tal-Kollateral", imma dan il-valur għandu jkun konsistenti matul il-ħajja tal-portafoll u m'għandux ikun assenjat mill-ġdid kuljum għall-istess portafoll. Fl-istess ħin, kontropartijiet differenti jistgħu jużaw kodiċijiet tal-portafoll tal-kollateral differenti għall-istess grupp ta' derivattivi.

### 5.3.1 Ir-rapportar tal-aġġornament tal-marġni għal derivattiv ġdid mhux kollateralizzat

549. It-Tabella 85 turi l-mili tal-kampijiet tar-rapportar meta l-kontroparti tippreżenta r-rapport tal-marġni għal derivattiv mhux kollateralizzat. Mhuwiex neċessarju li jintbagħtu iktar aġġornamenti tal-marġni, sakemm ma tinbidilx il-kategorija ta' kollateralizzazzjoni.

| Tabella 85 – Rapport tal-aġġornament tal-marġni għal derivattiv mhux kollateralizzat |                                        |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                  | Kamp                                   | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 3.8                                                                                  | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral | FALZ    | <pre> &lt;Rpt&gt;   &lt;MrgnUpd&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         UTI3       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;     &lt;Coll&gt;       &lt;CollPrtf1Cd&gt;         &lt;Prtf1&gt;           &lt;NoPrtf1&gt;             &lt;Rsn&gt;NOAP&lt;/Rsn&gt;           &lt;/NoPrtf1&gt;         &lt;/Prtf1&gt;       &lt;/CollPrtf1Cd&gt;       &lt;CollstnCtgy&gt;         UNCL       &lt;/CollstnCtgy&gt;     &lt;/MrgnUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt; </pre> |
| 3.9                                                                                  | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral    |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 3.10                                                                                 | UTI                                    | UTI3    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 3.11                                                                                 | Kategorija ta' kollateralizzazzjoni    | UNCL    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 3.28                                                                                 | Tip ta' azzjoni                        | MARU    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |

### 5.3.2 Ir-rapportar ta' marġni għal derivattiv ġdid kollateralizzat fil-livell tal-portafoll

550. Fix-xenarju ta' hawn taħt, il-kontroparti li tirrapporta, il-Kontroparti J (bil-LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCCCC) hija wkoll membru tal-ikklerjar. Hi tirrapporta l-ammont ta' EUR 1,000,000 depożitat bħala l-marġni inizjali u l-ammont ta' EUR 300,000 bħala l-marġni ta' varjazzjoni depożitat lis-CCP O (bil-LEI BBBBBBBBBBBB1111111111). Il-kontroparti tirrapporta wkoll kollateral eċċessiv ta' EUR 100,000.

| Tabella 86 - Aġġornament tal-marġni fil-livell tal-portafoll għal derivattiv ikklerjat |                           |                      |                                                                            |
|----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|----------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                    | Kamp                      | Eżempju              | Messaġġ XML                                                                |
| 3.1                                                                                    | Kronogramma tar-rapportar | 2023-07-19T18:05:45Z | <pre> &lt;MrgnUpd&gt;   &lt;RptgTmStmp&gt;     2023-07-19T18:05:45Z </pre> |

**Tabella 86 - Aġġornament tal-marġni fil-livell tal-portafoll għal derivattiv ikklerjat**

| Nru  | Kamp                                                            | Eżempju                    | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|-----------------------------------------------------------------|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 3.2  | ID tal-entità li tippreżenta rapport                            | CCCCCCCCCCCCCCCC<br>CCCCC  | </RptgTmStmp><br><CtrPtyId><br><RptgCtrPty><br><Id><br><Lgl><br><Id><br><LEI><br>CCCCCCCCCCCCCCCCCC<br></LEI><br></Id><br></Lgl><br></Id><br></RptgCtrPty><br><OthrCtrPty><br><IdTp><br><Lgl><br><Id><br><LEI><br>BBBBBBBBBBBB1111111111<br></LEI><br></Id><br></Lgl><br></IdTp><br></OthrCtrPty><br><SubmitgAgt><br><LEI><br>CCCCCCCCCCCCCCCCCC<br></LEI><br></SubmitgAgt><br><NttyRspnsblForRpt><br><LEI><br>CCCCCCCCCCCCCCCCCC<br></LEI><br></NttyRspnsblForRpt><br></CtrPtyId><br><EvtDt><br>2023-07-18<br></EvtDt><br><Coll><br><CollPrtf1Cd><br><Prtf1><br><Cd><br>CODEPORTFOLIO123<br></Cd><br></Prtf1><br></CollPrtf1Cd><br><CollstnCntgy><br>OWC1 |
| 3.3  | Entità responsabbli mir-rapportar                               | CCCCCCCCCCCCCCCC<br>CCCCC  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.4  | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)                      | CCCCCCCCCCCCCCCC<br>CCCCC  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.5  | It-tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2                      | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.6  | Kontroparti 2                                                   | BBBBBBBBBBBB111111<br>1111 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.7  | Kronogramma tal-kollateral                                      | 2023-07-18T18:00:00Z       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.8  | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral                          | VERU                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.9  | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral                             | CODEPORTFOLIO123           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.10 | UTI                                                             |                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.11 | Kategorija ta' kollateralizzazzjoni                             | OWC1                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.12 | Marġni inizjali depożitat mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) | 1,000,000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 3.13 | Marġni inizjali depożitat mill-                                 | 1,000,000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

**Tabella 86 - Aġġornament tal-marġni fil-livell tal-portafoll għal derivattiv ikklerjat**

| Nru  | Kamp                                                                   | Eżempju | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|------|------------------------------------------------------------------------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | kontroparti 1 (wara l-haircut)                                         |         | <pre> &lt;/CollstnCtgy&gt; &lt;TmStmp&gt; 2023-07-18T18:00:00Z &lt;/TmStmp&gt; &lt;PstdMrgnOrColl&gt; &lt;InitlMrgnPstdPreHrcut Ccy="EUR"&gt;1000000 &lt;/InitlMrgnPstdPreHrcut&gt; &lt;InitlMrgnPstdPstHrcut Ccy="EUR"&gt;1000000 &lt;/InitlMrgnPstdPstHrcut&gt; &lt;VartnMrgnPstdPreHrcut Ccy="EUR"&gt;300000 &lt;/VartnMrgnPstdPreHrcut&gt; &lt;VartnMrgnPstdPstHrcut Ccy="EUR"&gt;300000 &lt;/VartnMrgnPstdPstHrcut&gt; &lt;XcssCollPstd Ccy="EUR"&gt;100000 &lt;/XcssCollPstd&gt; &lt;/PstdMrgnOrColl&gt; &lt;/MrgnUpd&gt; </pre> |
| 3.14 | Munita tal-marġni inizjali depożitat                                   | EUR     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.15 | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) | 300,000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.16 | Marġni ta' varjazzjoni depożitat mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)   | 300,000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.17 | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni depożitati                           | EUR     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.18 | Kollateral eċċessiv depożitat mill-kontroparti 1                       | 100,000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.19 | Munita tal-kollateral eċċessiv depożitat                               | EUR     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.20 | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut)           |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.21 | Marġni inizjali miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)             |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

| Tabella 86 - Aġġornament tal-marġni fil-livell tal-portafoll għal derivattiv ikklerjat |                                                                     |            |             |
|----------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------|------------|-------------|
| Nru                                                                                    | Kamp                                                                | Eżempju    | Messaġġ XML |
| 3.22                                                                                   | Munita tal-marġni inizjali miġbur                                   |            |             |
| 3.23                                                                                   | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) |            |             |
| 3.24                                                                                   | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)   |            |             |
| 3.25                                                                                   | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni miġbur                            |            |             |
| 3.26                                                                                   | Kollateral eċċessiv miġbur mill-kontroparti 1                       |            |             |
| 3.27                                                                                   | Munita tal-kollateral eċċessiv miġbur                               |            |             |
| 3.28                                                                                   | Tip ta' azzjoni                                                     | MARU       |             |
| 3.29                                                                                   | Data tal-event                                                      | 2023-07-18 |             |

### 5.3.3 Ir-rapportar ta' aġġornament tal-marġni fil-livell ta' tranżazzjoni individwali għal derivattiv mhux ikklerjat

551. Fix-xenarju li jmiss, żewġ kontropartijiet jiskambjaw il-kollateral għal derivattiv mhux ikklerjat. Żewġ kontropartijiet jiddepożitaw il-marġni inizjali u l-marġni ta' varjazzjoni skont il-ftehim kollaterali. Il-kontroparti A (bil-LEI 12345678901234500000) iddepożitat EUR 800,000 ta' marġni inizjali fi flus kontanti u EUR 220,000 ta' marġni inizjali f'titoli soġġetti għal haircut ta' 10 %. Il-kontroparti B (bil-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST) iddepożitat EUR 1,000,000 ta' marġni inizjali fi flus kontanti. Il-kontroparti B se tkun mistennija wkoll tiddepożita EUR 100,000 ta' marġni varjabbli fuq l-iktar valwazzjoni riċenti tal-kuntratt,

madankollu dan l-ammont huwa inqas mill-ammont ta' trasferiment minimu (MTA) miftiehem bejn il-kontropartijiet.

| Tabella 87- Aġġornament tal-margni fuq livell ta' tranzazzjoni individwal għal derivattiv mhux ikklierjat |                                            |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                                                                                       | Kamp                                       | Eżempju                  | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3.1                                                                                                       | Kronogramma tar-rapportar                  | 2023-04-07T10:00:00Z     | <pre> &lt;MrgnUpd&gt;   &lt;RptgTmStmp&gt;     2023-04-07T10:00:00Z   &lt;/RptgTmStmp&gt;   &lt;CtrPtyId&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               12345678901234500000             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/Id&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;IdTp&gt;         &lt;Lgl&gt;           &lt;Id&gt;             &lt;LEI&gt;               ABCDEFGHIJKLMNOPQRST             &lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/Lgl&gt;       &lt;/IdTp&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;SubmitgAgt&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/SubmitgAgt&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;/CtrPtyId&gt;   &lt;EvtDt&gt;     2023-04-06   &lt;/EvtDt&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTxIdr&gt;           </pre> |
| 3.2                                                                                                       | ID tal-entità li tippreżenta rapport       | 12345678901234500000     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.3                                                                                                       | Entità responsabbli mir-rapportar          | 12345678901234500000     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.4                                                                                                       | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.5                                                                                                       | Tip ta' identifikatur tal-kontroparti 2    | VERU                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.6                                                                                                       | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMN<br>OPQRST |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.7                                                                                                       | Kronogramma tal-kollateral                 | 2023-04-06T20:30:00Z     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.8                                                                                                       | Indikatur tal-portafoll tal-kollateral     | FALZ                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.9                                                                                                       | Kodiċi tal-portafoll tal-kollateral        |                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.10                                                                                                      | UTI                                        | UTI1                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.11                                                                                                      | Kategorija ta' kollateralizzazzjoni        | FLCL                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 3.12                                                                                                      | Margni inizjali mill-depożitat             | 1,020,000                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

**Tabella 87- Aġġornament tal-marġni fuq livell ta' tranzazzjoni individwal għal derivattiv mhux ikklierjat**

| Nru  | Kamp                                                                                | Eżempju   | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | kontroparti 1<br>(qabel il-haircut)                                                 |           | <pre> &lt;/TxId&gt; &lt;Coll&gt;   &lt;CollPrtf1Cd&gt;     &lt;Prtf1&gt;       &lt;NoPrtf1&gt;         NOAP       &lt;/NoPrtf1&gt;     &lt;/Prtf1&gt;   &lt;/CollPrtf1Cd&gt;   &lt;CollstnCtgy&gt;     FLCL   &lt;/CollstnCtgy&gt;   &lt;TmStmp&gt;     2023-04-06T20:30:00Z   &lt;/TmStmp&gt;   &lt;PstdMrgnOrColl&gt;     &lt;InitlMrgnPstdPreHrcut       Ccy="EUR"&gt;1020000     &lt;/InitlMrgnPstdPreHrcut&gt;     &lt;InitlMrgnPstdPstHrcut       Ccy="EUR"&gt;998000     &lt;/InitlMrgnPstdPstHrcut&gt;   &lt;/PstdMrgnOrColl&gt;   &lt;RcvdMrgnOrColl&gt;     &lt;InitlMrgnRcvdPreHrcut       Ccy="EUR"&gt;         1000000     &lt;/InitlMrgnRcvdPreHrcut&gt;     &lt;InitlMrgnRcvdPstHrcut       Ccy="EUR"&gt;         1000000     &lt;/InitlMrgnRcvdPstHrcut&gt;     &lt;VartnMrgnRcvdPreHrcut       Ccy="EUR"&gt;         0     &lt;/VartnMrgnRcvdPreHrcut&gt;     &lt;VartnMrgnRcvdPstHrcut       Ccy="EUR"&gt;         0     &lt;/VartnMrgnRcvdPstHrcut&gt;   &lt;/RcvdMrgnOrColl&gt; &lt;/MrgnUpd&gt; </pre> |
| 3.13 | Marġni inizjali<br>depożitat mill-<br>kontroparti 1 (wara<br>l-haircut)             | 998,000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.14 | Munita tal-marġni<br>inizjali depożitat                                             | EUR       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.15 | Marġni ta'<br>varjazzjoni<br>depożitat mill-<br>kontroparti 1<br>(qabel il-haircut) |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.16 | Marġni ta'<br>varjazzjoni<br>depożitat mill-<br>kontroparti 1 (wara<br>l-haircut)   |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.17 | Munita tal-marġni<br>ta' varjazzjoni<br>depożitati                                  |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.18 | Kollateral eċċessiv<br>depożitat mill-<br>kontroparti 1                             |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.19 | Munita tal-<br>kollateral eċċessiv<br>depożitat                                     |           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.20 | Marġni inizjali<br>miġbur mill-<br>kontroparti 1<br>(qabel il-haircut)              | 1,000,000 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 3.21 | Marġni inizjali<br>miġbur mill-                                                     | 1000000   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

**Tabella 87- Aġġornament tal-marġni fuq livell ta' tranżazzjoni individwal għal derivattiv mhux ikklerjat**

| Nru  | Kamp                                                                | Eżempju    | Messaġġ XML |
|------|---------------------------------------------------------------------|------------|-------------|
|      | kontroparti 1 (wara l-haircut)                                      |            |             |
| 3.22 | Munita tal-marġni inizjali miġbur                                   | EUR        |             |
| 3.23 | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (qabel il-haircut) | 0          |             |
| 3.24 | Marġni ta' varjazzjoni miġbur mill-kontroparti 1 (wara l-haircut)   | 0          |             |
| 3.25 | Munita tal-marġni ta' varjazzjoni miġbur                            | EUR        |             |
| 3.26 | Kollateral eċċessiv miġbur mill-kontroparti 1                       |            |             |
| 3.27 | Munita tal-kollateral eċċessiv miġbur                               |            |             |
| 3.28 | Tip ta' azzjoni                                                     | MARU       |             |
| 3.29 | Data tal-event                                                      | 2023-04-06 |             |

## 6 Linji Gwida dwar il-ġestjoni tad-*data* tad-derivattivi

### 6.1 Rapport dwar l-Istat tan-Negożju

#### 6.1.1 Introduzzjoni

552. It-tnejn korretta tar-Rapport dwar l-Istat tan-Negożju (TSR) mit-TRs hija essenzjali sabiex jiġi żgurat il-ksib ta' wieħed mill-għanijiet ewlenin tal-EMIR – il-monitoraġġ tar-riskji sistemici għall-istabbiltà finanzjarja.
553. It-TRs għandhom jinkludu l-informazzjoni l-iktar aġġornata relatata mad-derivattivi pendenti fit-TSR sabiex jippermettu li l-awtoritajiet ikollhom aċċess dirett u immedjat għall-informazzjoni l-iktar granulari dwar l-iskoperturi għar-riskju eżistenti bejn il-kontropartijiet. It-TRs għandhom jippermettu wkoll li kull kontroparti individwali jkollha fehim ċar tal-iskoperturi tagħha stess fil-konfront ta' kull parteċipant fis-suq li miegħu għandha derivattiv miftuħ.
554. Ir-rekwiżiti għat-TRs biex jipproduċu TSR huma inklużi fl-Artikolu 2 u 5 tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data* u fl-Artikolu 4 tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*.
555. Fit-taqsimiet 0 u 3.6.2, l-ESMA tipprovdi kjarifiki dwar is-sekwenzi permessi tat-tipi ta' azzjoni u dwar il-kombinamenti permessi bejn it-tipi ta' azzjoni u t-tipi ta' eventi. Barra minn hekk, fit-taqsimi 3.9 l-ESMA tinkludi gwida fir-rigward tal-puntwalità tar-rapportar tal-konklużjoni, tal-modifika u tat-terminazzjoni ta' derivattiv.
556. It-TRs għandhom jużaw l-informazzjoni rapportata mill-kontropartijiet, mill-ERRs u mill-RSEs biex jippreparaw it-TSR. L-unika sitwazzjoni li fiha t-TRs jithallew jaġġornaw l-iktar TSR attwali mingħajr azzjoni mill-entitajiet imsemmijin qabel hija dettaljata fit-taqsimi 6.1.7.
557. Jekk kontroparti tuża parti terza biex tirrapporta t-tranzazzjonijiet tagħha, iżda l-kontroparti tippreżenta r-rapportar tal-valwazzjoni tagħha hi stess, għandu jkun possibbli li l-informazzjoni tar-rapportar kollha tingħaqad fit-TSR sabiex il-partijiet kollha jkollhom disponibbli l-informazzjoni rilevanti kollha. B'mod partikolari, it-TSR ipprovdut lill-awtoritajiet għandu jinkludi l-informazzjoni kollha, inkluż id-*data* dwar in-negożju, tal-valwazzjoni u tal-marġni.

#### 6.1.2 Trattament tad-*data* tal-event

558. Meta jkunu qed jibnu t-TSR, it-TRs għandhom iqisu l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja abbażi tal-ordni loġiku derivat mill-kampijiet "Data tal-event", "Tip ta' azzjoni" u "Tip ta' event". It-TRs għandhom jaġġornaw it-TSR abbażi tal-aħħar informazzjoni għal derivattiv partikolari kif derivat mill-kamp "Data tal-event". Fil-każ tar-rapporti tal-valwazzjoni u tal-marġni bl-istess data tal-event, it-TRs għandhom ukoll iqisu l-kampijiet "Kronogramma tal-valwazzjoni" u "Kronogramma tal-kollateral", rispettivament.

559. Jekk għal data tal-event partikolari jkun hemm diversi avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja li jaffettwaw id-*data* rapportata għal derivattivi partikolari, dawn għandhom kollha jiġu inklużi fl-aħħar rapport għal dik id-*data* tal-event u għat-tip ta' azzjoni partikolari. It-TRs għandhom għalhekk iqisu l-kamp "Kronogramma tar-rapportar" biss fir-rigward tad-*data* tal-event partikolari.
560. It-TRs għandhom jiżguraw li l-kuntratti tad-derivattivi li jimmaturow f'għurnata partikolari xorta jiġu inklużi fit-*TSR* għal dik il-għurnata.
561. L-informazzjoni minn avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja ppreżentati preċedentement għandhom b'mod ġenerali jippersistu fit-*TSR* meta l-kontropartijiet jirrapportaw avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja sussegwenti li għalihom ċerti kampijiet ma jkunux mitluba li jimtlew (jiġifieri mhumiex applikabbli). Għall-kuntrarju, it-TRs m'għandhomx iżommu l-informazzjoni preċedenti fit-*TSR* aġġornat meta l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja sussegwenti ppreżentati mill-kontropartijiet iħallu ċerti kampijiet fakultattivi vojta. Il-kontropartijiet għandhom jirrapportaw b'mod konsistenti l-informazzjoni fakultattiva sabiex jevitaw it-tħassir ta' informazzjoni disponibbli, li inkella twassal għal diskrepanzi fir-rikonċiljazzjoni u informazzjoni nieqsa fl-istat tan-negozju l-iktar riċenti.
562. It-TRs għandhom jaġġornaw l-istat fil-passat għad-derivattivi kollha pendenti, filwaqt li għal derivattivi mhux pendenti, it-TRs għandhom ikunu f'pożizzjoni li jaġġornaw l-istat tagħhom għal massimu ta' għaxar snin wara l-maturità jew it-terminazzjoni tagħhom. Dan il-limitu huwa relatat mar-rekwiżit skont l-Artikolu 80(3) tal-EMIR għat-TRs biex iżommu rekords tad-derivattivi għal minimu ta' għaxar snin wara l-maturità jew it-terminazzjoni tagħhom.
563. L-aġġornament tal-istat fil-passat ma jimplikax li t-TRs għandhom jirriproduċu u jibagħtu *TSRs* storiċi korretti fuq bażi rikorrenti u b'mod awtomatizzat kull darba li jaslu rapporti jew avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja mogħtijin tard li jirreferu għal dati tal-event fil-passat. It-*TSR* prodott għal data speċifika għandu jitqies bħala ritratt tal-informazzjoni kollha disponibbli f'punt partikolari fiż-żmien. Madankollu, huwa essenzjali li l-bażijiet tad-*data* interni tat-TRs ikunu dejjem aġġornati kif xieraq meta jaslu tali rapporti.
564. It-TRs għandu jkollhom stabbilit proċess għar-riproduzzjoni u għad-dispaċċ tat-*TSRs* storiċi korretti abbażi ta' talbiet ad-hoc li jsiru mill-awtoritajiet jew mill-kontropartijiet, mill-RSEs u mill-ERRs. Tali *TSRs*, meta riprodotti, għandhom jinkludu informazzjoni nieqsa minn rapporti u avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja ppreżentati tard li jirreferu għal-dati tal-event fil-passat li ma ġewx inklużi fit-*TSR* oriġinali prodott f'punt speċifiku fiż-żmien fil-passat. It-TRs għandhom jagħmlu użu mill-parti tal-prefiss tal-verżjoni tal-konvenzjoni għall-għoti ta' isem TRACE biex jagħmlu distinzjoni bejn verżjonijiet antiki u verżjonijiet iktar riċenti.

565. It-tabelli ta' hawn taht juru l-logika għal każijiet tal-użu differenti:

**Każ tal-użu 1:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “NEWT” għal data tal-event preċedenti

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | <b>NEWT</b>     | T                         | T-3            | 100        | -           | -                |

| Il-baži tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramm a tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonal i | Ammon t Val. | Kronogramm a Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------|--------------|-------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                             | T-3         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                             | T-2         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                             | T-1         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                             | T           | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |

| Il-baži tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramm a tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonal i | Ammon t Val. | Kronogramm a Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------|--------------|-------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                            | T-3         | NEWT            | T                          | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                            | T-2         | NEWT            | T                          | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                            | T-1         | NEWT            | T                          | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                            | T           | NEWT            | T                          | T-3            | 100         | -            | -                 |

It-TR għandu jimla l-baži tad-data tiegħu bl-istorja minn T-3 sa T.

**Każ tal-użu 2:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “MODI” għal data tal-event preċedenti

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | <b>MODI</b>     | T                         | T-2            | 120        | -           | -                |

| Il-baži tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramm a tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonal i | Ammon t Val. | Kronogramm a Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------|--------------|-------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                        | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                             | T-2         | NEWT            | T-3                        | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                             | T-1         | NEWT            | T-3                        | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                             | T           | NEWT            | T-3                        | T-3            | 100         | -            | -                 |

| Il-baži tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramm a tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonal i | Ammon t Val. | Kronogramm a Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------|--------------|-------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                          | -              | -           | -            | -                 |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                        | T-3            | 100         | -            | -                 |
|                                            | T-2         | MODI            | T                          | T-2            | 120         | -            | -                 |

|     |      |   |     |     |   |   |
|-----|------|---|-----|-----|---|---|
| T-1 | MODI | T | T-2 | 120 | - | - |
| T   | MODI | T | T-2 | 120 | - | - |

IT-TR għandu jimmodifika l-informazzjoni maħżuna fil-bażi tad-data tiegħu minn T-2 sa T.

**Każ tal-użu 3:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “CORR” li jinkludi kemm dettalji tan-negozju u tal-valwazzjoni minn data tal-event preċedenti

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | <b>CORR</b>     | T                         | T-2            | 140        | 110         | T-2              |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3              |
|                                             | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 95          | T-2              |
|                                             | T-1         | VALU            | T-1                       | T-1            | 100        | 94          | T-1              |
|                                             | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 93          | T                |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3              |
|                                            | T-2         | CORR            | T                         | T-2            | 140        | 110         | T-2              |
|                                            | T-1         | CORR            | T                         | T-2            | 140        | 94          | T-1              |
|                                            | T           | CORR            | T                         | T-2            | 140        | 93          | T                |

It-TR għandu jikkoreġi d-dettalji tan-negozju minn T-2 sa T u d-dettalji tal-valwazzjoni għandhom jiġu korretti biss minn T-2 sa T-2 sabiex jinżammu l-iktar aġġornamenti tal-valwazzjoni reċenti.

**Każ tal-użu 4:** L-avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “CORR” li jinkludi kemm dettalji tan-negozju u tal-valwazzjoni għal data tal-event preċedenti li taqa' bejn “NEWT” kif ukoll avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja ieħor (eż. “MODI”)

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | <b>CORR</b>     | T                         | T-2            | 140        | 110         | T-2              |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3              |
|                                             | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 95          | T-2              |
|                                             | T-1         | VALU            | T-1                       | T-1            | 100        | 94          | T-1              |

|  |   |      |   |   |     |    |     |
|--|---|------|---|---|-----|----|-----|
|  | T | MODI | T | T | 120 | 94 | T-1 |
|--|---|------|---|---|-----|----|-----|

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3              |
|                                            | T-2         | CORR            | T                         | T-2            | 140        | 110         | T-2              |
|                                            | T-1         | CORR            | T                         | T-2            | 140        | 94          | T-1              |
|                                            | T           | MODI            | T                         | T              | 120        | 94          | T-1              |

It-TR għandu jikkoreġi d-dettalji tan-negozju minn T-2 sa T-1 sabiex jevita li l-informazzjoni mill-avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "MODI" iktar reċenti tiġi sostitwita, u d-dettalji tal-valwazzjoni għandhom jiġu korretti biss minn T-2 sa T-2 sabiex jinżammu l-iktar aġġornamenti tal-valwazzjoni reċenti.

**Każ tal-użu 5:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "TERM" għal data tal-event preċedenti

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data tat-terminazzjoni bikrija |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|--------------------------------|
|                                | TERM            | T                         | T-2            | -          | -           | T-2                            |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data tat-terminazzjoni bikrija |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|--------------------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                              |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3                            |
|                                             | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 95          | T-2                            |
|                                             | T-1         | VALU            | T-1                       | T-1            | 100        | 94          | T-1                            |
|                                             | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 93          | T                              |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data tat-terminazzjoni bikrija |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|--------------------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                              |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3                            |
|                                            | T-2         | TERM            | -                         | -              | -          | -           | -                              |
|                                            | T-1         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                              |
|                                            | T           | -               | -                         | -              | -          | -           | -                              |

It-TR għandu jdaħħal it-terminazzjoni tad-derivattiv pendenti f'T-2 u għandu jneħhi l-istorja minn dik id-data 'l quddiem.

**Każ tal-użu 6:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "VALU" għal data tal-event preċedenti

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | VALU            | T                         | T-2            | -          | 100         | T-2              |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammon t Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|--------------|------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -            | -                |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                             | T-2         | MODI            | T-2                       | T-2            | 120        | -            | -                |
|                                             | T-1         | MODI            | T-2                       | T-2            | 120        | -            | -                |
|                                             | T           | MODI            | T-2                       | T-2            | 120        | -            | -                |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammon t Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|--------------|------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -            | -                |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                            | T-2         | VALU            | T                         | T-2            | 120        | 100          | T-2              |
|                                            | T-1         | VALU            | T                         | T-2            | 120        | 100          | T-2              |
|                                            | T           | VALU            | T                         | T-2            | 120        | 100          | T-2              |

Peress li m'hemmx iktar informazzjoni tal-valwazzjoni reċenti, it-TR għandu jaġġorna l-informazzjoni tal-valwazzjoni rilevanti minn T-2 għal T, u mhux biss għal T-2, l-informazzjoni dwar id-dettalji tan-negozju tibqa' l-istess.

**Każ tal-użu 7:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "VALU" għal data tal-event preċedenti li taqa' bejn "NEWT" u avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "VALU" ieħor

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammon t Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|--------------|------------------|
|                                | VALU            | T                         | T-2            | -          | 90           | T-2              |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammon t Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|--------------|------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -            | -                |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                             | T-2         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                             | T-1         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                             | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 95           | T                |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammon t Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|--------------|------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -            | -                |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -            | -                |
|                                            | T-2         | VALU            | T                         | T-2            | 100        | 90           | T-2              |
|                                            | T-1         | VALU            | T                         | T-2            | 100        | 90           | T-2              |
|                                            | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 95           | T                |

It-TR għandu jaġġorna l-informazzjoni tal-valwazzjoni rilevanti minn T-2 sa T-1 u jżomm l-informazzjoni tal-valwazzjoni mill-avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “VALU”-l-iktar reċenti.

**Każ tal-użu 8:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “EROR”

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | <b>EROR</b>     | T                         | T              | -          | -           | -                |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | -                |
|                                             | T-2         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | -                |
|                                             | T-1         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | -                |
|                                             | T           | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | -                |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T-3         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T-2         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T-1         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |
|                                            | T           | -               | -                         | -              | -          | -           | -                |

Id-data tal-event ta' avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “EROR” għandha dejjem tkun l-istess bħad-data tar-rapportar. Madankollu, it-TR għandu jneħhi l-informazzjoni mid-data tal-bidu, jiġifieri d-data tal-event ta' “NEWT”.

**Każ tal-użu 9:** Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “REVI”

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data ta' skadenza |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|-------------------|
|                                | <b>REVI</b>     | T                         | T              | 100        | 94          | T+20              |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data ta' skadenza |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|-------------------|
|                                             | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                 |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T+20              |
|                                             | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 94          | T+20              |
|                                             | T-1         | TERM            | T-1                       | T-1            | -          | -           | -                 |
|                                             | T           | -               | -                         | -              | -          | -           | -                 |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Data ta' skadenza |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|-------------------|
|                                            | T-4         | -               | -                         | -              | -          | -           | -                 |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | -                 |

|  |     |      |     |     |     |    |      |
|--|-----|------|-----|-----|-----|----|------|
|  | T-2 | VALU | T-2 | T-2 | 100 | 94 | -    |
|  | T-1 | REVI | T   | T   | 100 | 94 | T+20 |
|  | T   | REVI | T   | T   | 100 | 94 | T+20 |

Id-data tal-event ta' avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja "REVI" għandha dejjem tkun l-istess bħad-data tar-rapportar. Madankollu, it-TR għandu jiftaħ mill-ġdid il-kuntratt tad-derivattiv billi jibda mid-data tat-terminazzjoni, jiġifieri T-1 f'dan il-każ.

**Każ tal-użu 10:** Rapportar ta' diversi valwazzjonijiet għall-istess data tal-event

| Avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                | VALU            | T                         | T-1            |            | 95          | T 18:00:00       |

| Il-bażi tad-data tat-TR qabel l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|---------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                             | T-4         |                 |                           |                |            |             |                  |
|                                             | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3 18:00:00     |
|                                             | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 95          | T-2 18:00:00     |
|                                             | T-1         | VALU            | T-1                       | T-1            | 100        | 94          | T-1 16:00:00     |
|                                             | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 93          | T 18:00:00       |

| Il-bażi tad-data tat-TR wara l-aġġornament | Data tat-TR | Tip ta' azzjoni | Kronogramma tar-rapportar | Data tal-event | Nozzjonali | Ammont Val. | Kronogramma Val. |
|--------------------------------------------|-------------|-----------------|---------------------------|----------------|------------|-------------|------------------|
|                                            | T-4         |                 |                           |                |            |             |                  |
|                                            | T-3         | NEWT            | T-3                       | T-3            | 100        | -           | T-3 18:00:00     |
|                                            | T-2         | VALU            | T-2                       | T-2            | 100        | 95          | T-2 18:00:00     |
|                                            | T-1         | VALU            | T-1                       | T-1            | 100        | 95          | T-1 18:00:00     |
|                                            | T           | VALU            | T                         | T              | 100        | 93          | T 18:00:00       |

L-entità bagħtet iktar minn rapport tal-valwazzjoni wieħed għall-istess data tal-event. F'dan il-każ, it-TR għandu jaġġorna t-TR għad-data T-1, peress li l-kronogramma tal-valwazzjoni ppreżentata fit-tieni rapport hija iktar tard mill-kronogramma tal-valwazzjoni ppreżentata fl-ewwel rapport.

L-istess loġika għandha tapplika fil-każ ta' diversi rapporti tal-marġni għall-istess data tal-event – f'dan il-każ it-TRs għandhom iqisu l-kronogramma tal-kollateral.

### 6.1.3 Natura unika tad-derivattivi u kampijiet speċjali

566. In-natura unika tad-derivattivi sal-applikazzjoni tat-RTS dwar ir-rapportar rivedut kienet żgurata fil-livell tal-kombinament ta' LEI1-LEI2-UTI. Għandu jiġi nnotat li t-TRs użaw dan il-kombinament uniku biex jinkorporaw kwalunkwe modifika jew it-terminazzjoni fid-derivattivi.

567. Mid-data tal-applikazzjoni tal-istandards tekniċi riveduti dwar ir-rapportar skont l-EMIR, in-natura unika tad-derivattivi konklużi wara dik id-data għandha tiġi żgurata fil-livell tal-UTI, jiġifieri għad-derivattivi konklużi wara dik id-data m'għandux ikun hemm żewġ UTIs l-istess, irrISPettivament mill-kombinament tal-kontropartijiet. Dan huwa ovvjament minkejja li għar-rapporti ta' żewġ naħat (jiġifieri fejn iż-żewġ naħat jirrapportaw skont l-EMIR), l-istess UTI jidher darbtejn, rapportat minn kwalunkwe mill-kontropartijiet.
568. Minn dik id-data 'il quddiem, it-TRs għandhom għalhekk jużaw it-tripletta sħiħa (LEI1-LEI2-UTI) biss biex jaġġornaw l-istat tad-derivattivi konklużi qabel id-data tal-applikazzjoni tal-RTS dwar ir-rapportar. Biex jaġġornaw l-istat tad-derivattivi konklużi wara d-data tal-applikazzjoni tal-RTS dwar ir-rapportar, it-TRs jistgħu jużaw il-kombinament LEI1-UTI. Għal raġunijiet ta' semplicità, it-TRs jistgħu jużaw it-tripletta sħiħa fil-każijiet kollha biex jaġġornaw l-istat tad-derivattivi (inklużi derivattivi konklużi wara d-data tal-applikazzjoni tal-RTS dwar ir-rapportar). In-natura unika tal-UTIs rapportati reċentement għandha tkun żgurata mill-kontropartijiet u mill-ERRs meta jirrapportaw u mit-TRs meta jivverifikaw ir-rapporti f'konformità mar-regoli tal-validazzjoni.
569. Il-kontropartijiet u t-TRs għandhom jiġu mfakkra li r-rekwiżit inkluż fl-Artikolu 8 tal-ITS dwar ir-rapportar huwa l-uniku mod li l-kontropartijiet li jirrapportaw u l-ERRs jaġġornaw iż-żewġ LEIs.
570. Il-kontropartijiet m'għandhomx jemendaw il-kampijiet 1.4 "Kontroparti", 1.9 "Kontroparti 2" u 2.1 "UTI" ta' sottomissjonijiet preċedenti billi jipprezentaw rapport bit-tip ta' azzjoni "CORR" u t-TRs m'għandhomx jaċċettaw sottomissjonijiet bħal dawn. Barra minn hekk, mhuwiex possibbli li l-informazzjoni rapportata fil-kampijiet "Data tal-event", "Tip ta' event", "Kronogramma tar-rapportar" u "Tip ta' azzjoni" tiġi korretta, peress li l-informazzjoni inkluża f'dawn il-kampijiet fir-rapport bit-tip ta' azzjoni "CORR" se tirreferi għall-korrezzjoni, iktar milli għas-sottomissjonijiet preċedenti.

#### 6.1.4 Trattament tat-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid".

571. Meta l-kontroparti jew l-ERR tippreżenta rapport bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid", it-TR għandu jipproċessa r-rapport, abbażi tal-informazzjoni inkluża fil-kampijiet "Data ta' skadenza" jew "Data tat-terminazzjoni bikrija", jivvaluta jekk għandux jerga' jiġi inkluż fit-TSR jew sempliciment jaġġorna l-bażi tad-data interna tiegħu relatata ma' dak id-derivattiv (ara wkoll eżempju dwar l-aġġornament tat-TSR wara rapport bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid" fit-taqsima 6.1.2).
572. Il-kontroparti li tirrapporta jew l-ERR għandha ttipprovdi informazzjoni kompleta dwar id-data ta' skadenza u d-data tat-terminazzjoni bikrija ta' derivattiv. L-informazzjoni pprovduta għandha ssegwi s-sekwenza tal-iskeda ta' żmien loġika inkluża fir-regoli ta' validazzjoni. B'mod partikolari, id-data tat-terminazzjoni bikrija m'għandhiex tkun fil-futur.
573. Il-kamp "Data tal-event" u l-parti tad-data tal-kamp "Kronogramma tar-rapportar" għar-rapporti bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid" għandhom ikunu l-istess.

574. Fil-każ li d-data ta' skadenza fir-rapport tad-derivattiv tkun fil-futur jew ma tkunx mimlija, u d-data tat-terminazzjoni bikrija ma tkunx mimlija, it-TR għandu jinkludi d-derivattiv fit-TSR bil-valuri kollha li ġew inklużi fis-sottomissjoni bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid".
575. Fil-każ li d-data ta' skadenza jew id-data tat-terminazzjoni bikrija jkunu t-tnejn fil-passat, it-TR għandu jaġġorna r-rekords tiegħu stess, iżda mhux it-TSR.
576. Fil-każ li d-data ta' skadenza tkun fil-futur, iżda d-data tat-terminazzjoni bikrija tkun fil-passat, it-TR għandu jaġġorna r-rekords tiegħu stess, iżda mhux it-TSR.
577. Fil-każ li d-data tat-terminazzjoni bikrija tkun mimlija b'data wara d-data tal-event jew meta timentala b'data b'hal jew wara d-data ta' skadenza, tali rapport ma jaffettwax it-TSR peress li jiġi rrifjutat minħabba li ma jkunx konformi mar-regoli tal-validazzjoni. It-tabella ta' hawn taħt tiġbor fil-qosor is-sitwazzjonijiet rilevanti.

| Tabella 88 - Interazzjoni bejn it-TSR u r-rapporti bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid" |                                                        |                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| Data ta' skadenza                                                                       | Data tat-terminazzjoni bikrija                         | Effett fuq it-TSR                                                                      |
| Qabel id-data tal-event                                                                 | Qabel id-data tal-event                                | L-ebda effett fuq it-TSR, il-baži tad- <i>data</i> interna biss għandha tiġi aġġornata |
| Bħad-data tal-event                                                                     | Vojt                                                   | Aġġorna t-TSR u l-baži tad- <i>data</i> interna                                        |
| Bħad-data tal-event                                                                     | Qabel id-data tal-event                                | L-ebda effett fuq it-TSR, il-baži tad- <i>data</i> interna biss għandha tiġi aġġornata |
| Wara d-data tal-event jew voj                                                           | Vojt                                                   | Aġġorna t-TSR u l-baži tad- <i>data</i> interna                                        |
| Wara d-data tal-event jew voj                                                           | B'hal jew qabel id-data tal-event                      | L-ebda effett fuq it-TSR, il-baži tad- <i>data</i> interna biss għandha tiġi aġġornata |
| Wara d-data tal-event jew voj                                                           | Qabel id-data ta' skadenza, iżda wara d-data tal-event | L-ebda effett fuq it-TSR (irrifjutat)                                                  |
| Qabel, b'hal jew wara d-data tal-event                                                  | B'hal jew wara d-data tal-event                        | L-ebda effett fuq it-TSR (irrifjutat)                                                  |

#### 6.1.5 Rapportar bit-tip ta' azzjoni "EROR" u "REVI"

578. Fil-każ li kontroparti tibgħat rapport "EROR" għan-naħa tagħha tad-derivattiv, it-TR li rċieva tali rapport għandu jneħhi d-derivattiv rapportat minn dik il-kontroparti mit-TSR. It-TR għandu jagħmel dan anki meta l-kontroparti l-oħra tirrapporta lill-istess TR u ma tkunx għamlet l-istess rapport. Il-kontropartijiet għandhom ikunu responsabbli li jsolvu kwalunkwe tip ta' tqabbil hażin ikkawżat mill-użu tar-rapporti "EROR".

579. It-TR għandu jagħti d-derivattiv lit-TSR meta rapport bit-tip ta' azzjoni "Ftuħ mill-ġdid" jiġi riċevut u jkun konformi mar-regoli tal-validazzjoni u mar-regoli loġiċi inkluzi fit-tabella fil-paragrafu 576. It-TR għandu jagħmel dan anki meta l-kontroparti l-oħra tirrapporta lill-istess TR u ma tkunx għamlet l-istess rapport. Il-kontropartijiet għandhom ikunu responsabbli li jsolvu kwalunkwe tip ta' tqabbil hażin ikkawżat mill-użu tar-rapporti "REVI".

#### 6.1.6 Inkluzjoni fit-TSR ta' informazzjoni dwar l-iskeda

580. L-RTS u l-ITS dwar ir-rapportar jagħtu dettalji dwar ir-rekwiżiti għar-rapportar tal-iskedi nozzjonali u tal-pagamenti oħra.

581. It-TRs għandhom jinkludu fit-TSR biss il-valur attwali mill-iskedi rapportati, minflok jinkludu l-valuri kollha mill-iskedi. Dan għandu jiġi applikat għall-kampijiet tal-iskeda li ġejjin: 2.50-2.52 ("Prezz"), 2.57-2.59 ("Ammont nozzjonali tal-komponent 1"), 2.61-2.63 ("Kwantità nozzjonali tal-komponent 1"), 2.66-2.68 ("Ammont nozzjonali tal-komponent 2"), 2.70-2.72 ("Kwantità nozzjonali tal-komponent 2"), u 2.135-2.137 ("Prezz tal-eżerċitar"). Dan se jnaqqas l-ammont tad-data pprovduta lill-awtoritajiet u jiffaċilita l-valwazzjoni immedjata tal-iskoperturi.

582. It-TRs għandhom jużaw il-kampijiet tad-data li jirreferu għad-data effettiva u għad-data tal-għeluq tal-informazzjoni misjuba fl-iskeda biex jiddeterminaw liema punt tad-data għandhom idaħħlu fit-TSR. Pereżempju, skeda bil-karatteristiċi li ġejjin hija rapportata: "valur" {100, 150, 200}, "data effettiva" {T, T+10, T+20}, "data tal-għeluq" {T+9, T+19, T+29}. It-TSRs iġġenerati għad-dati tar-rapportar T sa T+9 għandhom juru l-valur 100, it-TSRs iġġenerati għad-dati tar-rapportar T+10 sa T+19 għandhom juru l-valur 150, u finalment, it-TSRs iġġenerati għad-dati tar-rapportar T+20 sa T+29 għandhom juru l-valur 200.

583. Għall-kampijiet 2.73-2.78, li jirreferu għall-pagamenti oħra, it-TRs għandhom jinkludu fit-TSR il-pagamenti kollha rilevanti. Il-pagamenti ta' tipi differenti m'għandhomx jiġu sostitwiti. Dan ifisser li jekk kontroparti tirrapporta l-istess tip ta' pagament iktar minn darba waħda (f'rapporti differenti), it-TSR għandu jaġġorna tali valur. L-eżempju ta' hawn taħt juri l-loġika:

| Data tal-event | Rapporti CP          | TSR għal dik il-ġurnata                   |
|----------------|----------------------|-------------------------------------------|
| T              | UFRO, 100            | UFRO, 100                                 |
| T+1            | PEXH, 150; PEXH, 200 | UFRO, 100; PEXH, 150; PEXH, 200           |
| T+2            | PEXH, 250; PEXH, 300 | UFRO, 100; PEXH, 250; PEXH, 300           |
| T+3            | UWIN, 50             | UFRO, 100; PEXH, 250; PEXH, 300; UWIN, 50 |

584. Għall-kampijiet 2.122-2.131, li jirreferu għall-komoditajiet, it-TRs għandhom jinkludu l-informazzjoni kollha kif inhi rapportata mill-kontropartijiet.
585. L-IDs ta' kollegament l-iktar aġġornati għandhom jippersistu fit-TSR meta kontroparti tirrapporta avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja fejn dawn il-kampijiet ma jkunux applikabbli. Għall-kuntrarju, l-IDs ta' kollegament m'għandhomx jippersistu fit-TSR meta kontroparti tirrapporta avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja fejn dawn il-kampijiet huma fakultattivi u rapportati bħala vojta. L-istess approċċ għandu japplika wkoll għall-kampijiet bħal "Tip ta' event".

#### 6.1.7 Derivattivi meġtin

586. Meta kontroparti tieqaf teżisti, mingħajr ma tiġi akkwistata jew tingħaqad, l-ebda derivattiv m'għandu jibqa' pendenti fir-repożitorju tat-tranzazzjonijiet.
587. Jekk il-kontroparti li tirrapporta tirrapporta direttament lit-TR u tinnotifika lit-TR sabiex tħassar is-sħubija tagħha, it-TR għandu jikkollabora mal-kontroparti li tirrapporta biex jitermina d-derivattivi rilevanti, meta tkun għadha attiva, billi jippreżenta rapporti bit-tipi ta' azzjoni "TERM" fil-każ li d-data tat-terminazzjoni tkun sa mhux iktar tard mid-data tax-xoljiment tal-kontroparti li tirrapporta.
588. Jekk il-kontroparti li tirrapporta ma tirrapportax direttament lit-TR, u l-ERR jew l-RSE jinnotifikaw lit-TR, it-TR għandu jikkollabora ma' dik l-entità biex l-ERR jew l-RSE jiterminaw id-derivattivi rilevanti, waqt li l-kontroparti li tirrapporta tkun għadha attiva, billi jippreżenta rapporti bit-tipi ta' azzjoni "TERM" fil-każ li d-data tat-terminazzjoni tkun mhux iktar tard mid-data tax-xoljiment tal-kontroparti li tirrapporta.
589. Jekk il-kontroparti li tirrapporta waqfet teżisti u ma tterminatx id-derivattivi pendenti u t-TR isir konxju ta' din is-sitwazzjoni, il-kaskata li ġejja għandha tiġi segwita:
- Jekk l-ERR tkun differenti mill-kontroparti li tirrapporta u dik l-ERR m'użatx RSE, it-TR għandu jikkuntattja lill-ERR, għandu jitlob is-sottomissjoni tar-rapporti bit-tipi ta' azzjoni "TERM" fil-każ li d-data tat-terminazzjoni tkun mhux akar tard mid-data tax-xoljiment tal-kontroparti li tirrapporta u, fl-istess ħin, għandu jippreżenta l-kwistjoni lill-ANK tal-kontroparti li tirrapporta. Jekk il-kontroparti li tirrapporta jew l-ERR użat RSE u dik l-entità għadha RSE attiva fit-TR, it-TR għandu jikkuntattja lill-RSE, għandu jitlob is-sottomissjoni tar-rapporti bit-tipi ta' azzjoni "TERM" fil-każ li d-data tat-terminazzjoni tkun mhux

aktar tard mid-data tax-xoljiment tal-kontroparti li tirrapporta u, fl-istess ħin, għandu jippreżenta l-kwistjoni lill-ANK tal-kontroparti li tirrapporta.

- b. Jekk il-pass preċedenti fil-punt a ma jkunx applikabbli, it-TR għandu jivvaluta d-data ta' maturità tad-derivattivi pendenti li għandhom jiġu terminati biex jivvaluta jekk jiskadux b'mod naturali fit-tmax-il xahar ta' wara. Jekk dak huwa l-każ, l-ebda azzjoni ulterjuri m'għandha tittiehed mit-TR. Dan huwa biex jitnaqqas ix-xogħol tat-TRs u biex jiġu minimizzati r-riskji assoċjati mal-proċess ta' esklużjoni tad-derivattivi meġtin.
- c. Jekk il-pass preċedenti fil-punt b ma jkunx applikabbli, it-TR għandu jikkuntattja lill-kontroparti(jiet) l-oħra fid-derivattivi pendenti, fil-każ li daww l-entitajiet jirrapportaw direttament lit-TR, u jitlobhom jiterminaw id-derivattivi pendenti f'isem il-kontroparti li tirrapporta filwaqt li, jekk possibbli, iressaq il-kwistjoni lill-ANK(s) biex jseguw mal-kontroparti(jiet) l-oħra.
- d. Finalment, fil-każ li l-ebda minn ta' hawn fuq ma jkun applikabbli, it-TR, malli jikkonferma mal-ANK u jinnotifika lill-ESMA, għandu jimmarka d-derivattivi rilevanti kif xieraq u ma jqishomx għall-iskopijiet tat-TSR, tal-proċess tar-rikonċiljazzjoni jew kwalunkwe aggregazzjonijiet sussegwenti bħal rapporti ta' pożizzjoni.

590. Fil-każ tad-derivattivi li baqgħu pendenti fid-data tal-applikazzjoni tar-rekwiżiti tar-rapportar ġodda, il-proċess imsemmi fil-paragrafu 589, għandu jitwettag mit-TRs fl-iktar opportunità kmieni u mhux iktar tard mit-tmiem tal-perjodu ta' tranżizzjoni.

## 6.2 Rikonċiljazzjoni

### 6.2.1 Kamp ta' applikazzjoni tad-data soġġetta għar-rikonċiljazzjoni

591. It-TRs għandhom jiżguraw determinazzjoni konsistenti tal-kamp ta' applikazzjoni tad-data soġġetta għar-rikonċiljazzjoni. Għalhekk, it-TRs għandhom jinkludu biss fil-proċess tar-rikonċiljazzjoni d-derivattivi, kemm fil-livell tan-negozju kif ukoll tal-pożizzjoni, jekk il-kondizzjonijiet kollha ta' hawn taħt ikunu ssodisfati:

- a. Il-kontroparti 1 għandha l-obbligu tar-rapportar, jiġifieri tkun kontroparti stabbilita fl-UE jew AIF, li l-AIFM tiegħu huwa stabbilit fl-UE, abbażi tal-GLEIF.
- b. Il-kontroparti 2 għandha l-obbligu tar-rapportar kif indikat jekk tkun stabbilita fl-UE jew AIF, li l-AIFM tiegħu huwa stabbilit fl-UE, abbażi tal-GLEIF jew il-kamp 1.14 "Obbligu ta' rapportar tal-kontroparti 2" jimtela b'"Veru".
- c. Id-derivattivi ma ġiex soġġett għal rapport bit-tip ta' azzjoni "EROR", sakemm ma ġiex segwit minn rapport bit-tip ta' azzjoni "REVI".
- d. Id-derivattivi huwa pendenti, kif imsemmi fl-Artikolu 2(2)(a) u 2(2)(b) tal-ITS dwar ir-rapportar, jew ilu pendenti fl-aħħar tletin jum kalendarju.

592. It-TRs għandhom jinkludu derivattivi rapportati tard fil-proċess tar-rikonċiljazzjoni jekk ir-rapport tard jirreferi għal derivattiv pendenti soġġett għar-rikonċiljazzjoni.

593. It-TRs għandhom ineħħu d-derivattivi mill-proċess tar-rikonċiljazzjoni li kienu mhux pendenti għal wiehied u tletin jum kalendarju jew iktar, u dan għandu jiġi determinat abbażi tad-data l-iktar bikrija rapportata fil-kamp “Data ta’ skadenza” jew “Data tat-terminazzjoni bikrija”. Barra minn hekk, id-derivattivi li rċevew rapport bit-tip ta’ azzjoni “EROR” ukoll għandhom jitneħħew.

594. Ta’ min ifakkar li t-TRs għandhom jirrikonċiljaw id-data f’konformità mat-tolleranza għar-rikonċiljazzjoni rilevanti, kif ukoll mad-data tal-bidu rilevanti kif inkluża fit-Tabella 2 tal-Anness għall-RTS dwar il-kwalità tad-data.

## 6.2.2 Rikonċiljazzjoni fil-livell tal-pożizzjoni vs fil-livell tan-negozju

595. It-TRs għandhom għalhekk jirrikonċiljaw, kemm rapporti fil-livell tal-pożizzjoni kif ukoll fil-livell tan-negozju, kif determinat mill-aħħar data tal-event applikabbli, li għandha tkun jumejn ta’ xogħol qabel id-data li fiha seħħet ir-rikonċiljazzjoni. Pereżempju, fil-każ li r-rikonċiljazzjoni sseħħ nhar ta’ Erbgħa, it-TRs għandhom jinkludu d-derivattivi rapportati li d-data tal-event tagħhom tkun it-Tnejn jew qabel. Fil-każ li r-rikonċiljazzjoni sseħħ it-Tnejn, it-TRs għandhom jinkludu d-derivattivi li d-data tal-event tagħhom tkun il-Ħamis jew qabel. Kalendajru Mira 2 għandu jintuża biex jiġu determinati l-jiem tax-xogħol.

**Tabella 89– Assimetriji fil-fluss tal-informazzjoni bejn il-proċess tar-rikonċiljazzjoni mwettaq b’dewmien ta’ jumejn u t-TSR**

| Jum tan-negozju | Data tal-event | Avvenimenti                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----------------|----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| T               | T              | <ul style="list-style-type: none"> <li>Il-kontropartijiet 1 u 2 iwettqu kuntratt tad-derivattiv ġdid f’<b>data tal-event T</b></li> <li>Il-kontroparti 1 tibgħat ir-rapport lit-TR fil-<b>jum tan-negozju T</b></li> </ul>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| T+1             | T+1            | <ul style="list-style-type: none"> <li>Il-kontroparti 2 tibgħat ir-rapport lit-TR fil-<b>jum tan-negozju T+1</b></li> <li>It-TSR konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+1</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> jinkludi l-aħħar stat tad-derivattivi rapportati fil-<b>jum tan-negozju T</b> bid-<b>data tal-event T-1</b> jew qabel, jiġifieri d-derivattiv ta’ hawn fuq mhuwiex inkluż.</li> <li>Ir-rapport tar-rikonċiljazzjoni konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+1</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> għad-</li> </ul> |

|     |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |     | <p><b>data tal-event T-2</b> jew qabel ma jinkludix id-derivattiv ta' hawn fuq.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Il-proċess tar-rikonċiljazzjoni jkompli sa' nofsillejl UTC għad-derivattivi rapportati matul il-<b>jum tan-negozju T</b> jew qabel bid-<b>data tal-event T-1</b> jew qabel.</li> </ul>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| T+2 | T+2 | <p>596. It-TSR konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+2</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> jinkludi l-aħħar stat tad-derivattivi rapportati fil-<b>jum tan-negozju T+1</b> bid-<b>data tal-event T</b> jew qabel, jiġifieri d-derivattiv ta' hawn fuq huwa <u>inkluż iżda għadu ma ġiex soġġett għar-rikonċiljazzjoni (marka ta' rikonċiljazzjoni = Mhux Applikabbli)</u>.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Ir-rapport tar-rikonċiljazzjoni konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+2</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> għad-<b>data tal-event T-1</b> jew qabel ma jinkludix id-derivattiv ta' hawn fuq</li> <li>Il-proċess tar-rikonċiljazzjoni jkompli sa' nofsillejl UTC għad-derivattivi rapportati matul il-<b>jum tan-negozju T+1</b> jew qabel bid-<b>data tal-event T</b> jew qabel.</li> </ul> |
| T+3 | T+3 | <p>597. It-TSR konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+3</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> jinkludi l-aħħar stat tad-derivattivi rapportati fil-<b>jum tan-negozju T+2</b> bid-<b>data tal-event T+1</b> jew qabel, jiġifieri d-derivattiv ta' hawn fuq huwa <u>inkluż u ġie soġġett għar-rikonċiljazzjoni (marka ta' rikonċiljazzjoni hija aġġornata kif xieraq)</u></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Ir-rapport tar-rikonċiljazzjoni konsenjat fil-<b>jum tan-negozju T+3</b> sa 06.00 UTC <b>lill-entitajiet / 12.00 UTC lill-awtoritajiet</b> għad-<b>data tal-event T</b> jew qabel jinkludi d-derivattiv ta' hawn fuq.</li> </ul>                                                                                                                                                                                                 |

### 6.2.3 Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni

598. Ir-rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni mill-perspettiva tal-livell tan-negozju jew tal-livell tal-pożizzjoni għandha ssegwi l-gwida pprovduta fit-taqsima 6.2.2.
599. Meta waħda mill-kontropartijiet fid-derivattiv tkun NFC-, dik l-entità mhijiex meħtieġa tirrapporta d-*data* tal-valwazzjoni. Anki jekk entità li mhijiex obbligata tirrapporta l-informazzjoni tal-valwazzjoni tagħmel dan, it-TRs għandhom iħallu barra tali informazzjoni mill-proċess tar-rikonċiljazzjoni.
600. Meta ż-żewġ kontropartijiet ikollhom obbligu li jirrapportaw il-valwazzjonijiet, it-TRs għandhom jinkludu d-*data* tal-valwazzjoni rilevanti kollha fil-proċess tar-rikonċiljazzjoni u jimmarkaw id-derivattivi fejn waħda mill-kontropartijiet ma

rrapportatx il-valwazzjoni jew fejn hemm diskrepanzi fir-rikonċiljazzjoni bejn l-informazzjoni kif mhux rikonċiljata.

601. Jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 6.3.3 dwar l-interazzjoni bejn ir-rikonċiljazzjoni tal-istatus tal-valwazzjoni mal-istatus tar-rikonċiljazzjoni tad-derivattiv.

#### 6.2.4 Derivattivi b'żewġ komponenti

1. It-TRs għandhom jirrikonċiljaw id-derivattivi b'żewġ komponenti billi jirrikonċiljaw kull wieħed mill-komponenti kif rapportati mill-kontropartijiet.
602. Ta' min jiġi nnotat li bħal fil-każ tal-biċċa l-kbira tad-derivattivi b'żewġ komponenti bħall-iswaps tar-rata tal-imġħax, l-iswaps bejn il-muniti u l-iswaps tal-valuti skont ir-rata tal-kambju, l-ordni tal-komponenti ma jistax jiġi definit b'mod ċar, peress li m'hemm l-ebda prevalenza speċifika ta' komponent wieħed fuq l-ieħor. Għalhekk, meta l-kontropartijiet jirrapportaw b'mod inkonsistenti ż-żewġ komponenti tad-derivattiv, it-TR għandu jkollu l-ħsieb li jqabbel iż-żewġ komponenti irrispettivament mis-sekwenza, filwaqt li jqis il-valuri rapportati miż-żewġ kontropartijiet skont il-kamp "Direzzjoni tal-komponent 1" billi jqabbel il-komponenti ma' valuri opposti. Fil-każ li l-kontroparti 1 irrapportatu b'"pagatur", it-TR għandu jirrikonċiljah mal-kamp li huwa identifikat bħala "riċevitur" jew mal-komponent li mhuwiex identifikat, meta l-komponent 1 ikun identifikat b'"pagatur".
603. Meta pożizzjoni pendenti tkun ir-riżultat ta' nnettjar ta' pożizzjoni għal żero (Livell = P u Kwantità = 0), it-TR għandu jeskludi mir-rikonċiljazzjoni l-kampijiet "Direzzjoni", "Direzzjoni tal-komponent 1" u "Direzzjoni tal-komponent 2".

#### 6.2.5 Rikonċiljazzjoni tal-informazzjoni dwar l-iskeda

604. It-TRs għandhom jirrikonċiljaw biss il-kampijiet tad-*data* dwar l-iskeda li huma inkluzi fit-TSR. Dan l-approċċ huwa allinjat ma' dak deskritt fit-taqsima 6.1.6 Inkluzjoni fit-TSR ta' informazzjoni dwar l-iskeda.

### 6.3 Feedback dwar il-kwalità tad-*data*

#### 6.3.1 Feedback dwar ir-rifjut

605. L-Artikolu 1(1) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* jeħtieġ li t-TRS jivverifikaw id-*data* li jirċievu mill-entitajiet li jipprezentaw rapport mal-wasla tagħha. F'konformità mal-Artikolu 1(3) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, it-TRs għandhom jipprovdu lill-RSEs informazzjoni dettaljata dwar ir-riżultati tal-verifika tad-*data*. Dan il-feedback dwar ir-rifjut immedjat għandu jiġi pprovdut lill-RSE rilevanti fi żmien 60 minuta mill-wasla tad-*data*, jiġifieri mill-mument li l-fajl ipprezentat jidhol fis-sistema tat-TR.
606. Minbarra l-provvista tar-rispons ta' rifjut immedjat lill-RSE, it-TR jista' jipprovdi dan il-feedback anke lill-kontropartijiet li jirrapportaw u lill-entitajiet responsabbli

mir-rapportar jekk dawk ikollhom aċċess għat-TR u juru interess li jirċievu r-rispons ta' rifjut immedjat.

607. L-Artikolu 1(1) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* jipprovdi lista ta' kontrolli tal-verifika speċifiċi li għandhom jitwettqu mit-TRs. L-awtentikazzjoni skont l-Artikolu 1(1)(a) għandha titwettaq minn qabel, għalhekk l-ebda feedback dwar ir-rifjut speċifiku m'għandu jiġi pprovdut fir-rigward ta' dan l-ewwel pass ta' verifika. Il-kontrolli ta' verifika li jifdal għandhom jitwettqu fil-punt tas-sottomissjoni u jirriżultaw f'feedback dwar ir-rifjut f'konformità mal-kategoriji ta' rifjut li ġejjin:
- a. Validazzjoni ta' skema ta' sottomissjoni skont l-Artikolu 1(1)(b);
  - b. Awtorizzazzjoni / permess ta' entità li tippreżenta rapport skont l-Artikolu 1(1)(c);
  - c. Validazzjoni loġika ta' sottomissjoni skont l-Artikoli 1(1)(d) sa 1(1)(k);
  - d. Regoli tan-negozju jew validazzjoni tal-kontenut ta' sottomissjoni skont l-Artikolu 1(1)(l), kif iċċarat minn dawn il-Linji Gwida.
608. Skont l-Artikolu 1(2) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, TR għandu "jirrifjuta rapport li ma jikkonformax ma' wieħed mir-rekwiżiti stabbiliti fil-paragrafu 1 u jassenjalu waħda mill-kategoriji ta' rifjut" imsemmijin hawn fuq.
609. Biex jiġu implimentati dawn il-kontrolli ta' verifika, it-TRs għandhom japplikaw ir-regoli ta' validazzjoni biex jiżguraw li r-rapportar jitwettaq f'konformità mar-reġim tal-EMIR, inkluż l-ispeċifikazzjoni tal-istandards tekniċi, kif iċċarat minn dawn il-Linji Gwida. Għalhekk, il-kontropartijiet li jirrapportaw jew l-entitajiet li jippreżentaw għandhom jikkonformaw mar-rekwiżiti tar-rapportar speċifikati mir-regoli ta' validazzjoni li huma ppubblikati flimkien ma' dawn il-Linji Gwida fuq is-sit web tal-ESMA.
610. Sabiex l-aspetti tekniċi tar-rekwiżiti tal-kwalità tad-*data* jinżammu rilevanti u jiġu applikati tajjeb, l-ESMA taggorna r-regoli tal-validazzjoni meta neċessarju jew xieraq. Meta r-regoli ta' validazzjoni jiġu aġġornati, l-ESMA tispeċifika l-ġurnata effettiva tal-applikazzjoni tar-regoli ta' validazzjoni aġġornati u t-TRs għandhom jiżguraw li jimplimentaw it-tibdil fil-hin speċifikat u jibdew iwettqu l-kontrolli tal-verifika bir-regoli ta' validazzjoni aġġornati dwar d-data tal-applikazzjoni deżinjata.
611. B'mod simili, il-kontropartijiet li jirrapportaw, l-ERRs jew l-RSEs kif applikabbli għandhom jaġġornaw is-sistemi tar-rapportar tagħhom sabiex ir-rapporti ppreżentati jkunu konformi mar-regoli ta' validazzjoni l-ġodda fid-data tal-applikazzjoni deżinjata.
612. Ir-regoli ta' validazzjoni fihom kodiċi ta' żball u messaġġ ta' żball speċifiċi li fihom perkors XML għal kull waħda mir-regoli ta' validazzjoni u t-TRs għandhom jużaw dawn il-kodiċijiet u l-messaġġi tal-iżball biex jispeċifikaw ir-raġuni għar-rifjut meta jikkomunikaw ir-rifjuti lill-partijiet rilevanti. Meta rapport tad-derivattiv jiġi rifjutat, ir-rispons tar-rifjut għandu jkun fiha l-kodiċijiet ta' żball kollha tar-regoli ta' validazzjoni li r-rapport tad-derivattiv ippreżentat m'għaddiex. Għalhekk, l-informazzjoni dwar il-kodiċijiet ta' żball għandhom jiġu pprovduti fil-livell tar-rapport.

613. Jekk ir-rapport ipprezentat ikun korrett u konformi mar-rekwiżiti tar-rapportar kollha, u mal-ispeċifikazzjonijiet tekniċi fir-regoli ta' validazzjoni, il-feedback għandu jindika li r-rapport tad-derivattivi għe aċċettat.
614. It-TR għandu jivverifika l-konformità tal-fajl mal-iskema XML (is-sintassi tal-fajl sħiħ u rapporti speċifiċi tad-derivattivi). Jekk il-fajl ma jkunx konformi, il-fajl kollu (id-derivattivi kollha inklużi fil-fajl) jiġi rrifjutat, u r-raġuni tkun li l-fajl huwa "korrott". Fl-istatistika dan għandu jiġi rapportat bħala rifjut tal-fajl 1 anki jekk il-fajl jikkontradixxi l-iskema XML f'diversi mument.
615. Jekk, madankollu, il-fajl ikun konformi mal-iskema XML u jkun fih eż. 3 derivattivi, iżda d-derivattivi kollha ma jgħaddux mill-validazzjonijiet, l-istatistika għandha turi l-fajl bħala aċċettat bi 3 derivattivi rrifjutati u 0 derivattivi aċċettati.
616. Wara l-wasla ta' rispons ta' rifjut immedjat, sabiex tiġi żgurata l-konformità tagħhom mal-obbligu ta' rapportar skont l-Artikolu 9 tal-EMIR, il-kontropartijiet li jirrapportaw jew l-ERR għandhom, direttament jew permezz ta' RSE, jipprezentaw rapporti korretti u kompleti sal-iskeda ta' żmien tar-rapportar.
617. Mal-feedback ta' rifjut immedjat, l-Artikolu 4(1)(c) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* teħtieġ li t-TRs jagħmlu disponibbli lill-kontropartijiet li jirrapportaw, lill-RSEs, lill-ERRs u lill-partijiet terzi li ngħataw aċċess għad-*data* tal-EMIR skont l-Artikolu 78(7) tal-EMIR rapporti tal-aħħar tal-ġurnata tad-derivattivi li ġew irrifjutati matul dik il-ġurnata. Kif speċifikat fl-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, dan ir-rapport għandu jsir aċċessibbli sa 6:00 UTC lill-entitajiet u 12:00 UTC lill-awtoritajiet fil-jum ta' xogħol ta' wara. Għad-determinazzjoni tal-jiem tax-xogħol, għandu jintuża l-kalendarju TARGET 2.
618. It-TRs għandhom jużaw id-*data* kollha li għabru biex jiddeterminaw liema informazzjoni għandhom jipprovdu u lil liema RSEs, ERRs u kontropartijiet. L-informazzjoni dwar l-iżbalji relatata mal-fajl kollu għandha ssir disponibbli lill-RSE tal-fajl u lill-ERRs u lill-kontropartijiet kollha mimlijin fil-kampijiet 1.3 u 1.4 f'dak il-fajl irrifjutat kif applikabbli, filwaqt li jitqies li jkun possibbli li l-informazzjoni tinqara mill-fajl irrifjutat. L-informazzjoni dwar l-iżbalji relatata ma' rekord speċifiku għandha ssir disponibbli għall-RSE, għall-ERR u għall-kontroparti 1 mimlijin f'dan ir-rekord sakemm l-entitajiet ikunu abbord.
619. Rigward id-dati tal-għeluq għall-provvista ta' (immedjata u tal-aħħar tal-ġurnata) rispons ta' rifjut f'ċirkostanzi speċjali, bħal manutenzjoni ppjanata jew mhux ipplanata, it-TRs għandhom jipproċedu b'mod analogu mal-gwida eżistenti dwar l-aspetti operattivi dwar l-aċċess għad-*data*, kif dettaljat fit-taqsima 6.4.1.

#### 6.3.1.1 Feedback dwar ir-rifjut immedjat

620. Rispons dwar ir-rifjut immedjat għandu, skont l-Artikolu 1(3) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, jiġi pprovdut mit-TRs fil-messaġġi tar-rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022, b'mod speċifiku l-iskema XSD. Għandu jinkludi din l-informazzjoni li ġejja:

**Tabella 90 - Feedback dwar ir-rifjut immedjat**

| Nru | Kamp                                       | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|--------------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Identifikazzjoni tal-fajl                  | Valur testwali                        | <pre> ... &lt;RjctnSttstcs&gt;   &lt;CtrPtyId&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;RptSubmitgNtty&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/RptSubmitgNtty&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;/CtrPtyId&gt;   &lt;RptSttstcs&gt;     &lt;Tt1NbOfRpts&gt;1&lt;/Tt1NbOfRpts&gt;     &lt;Tt1NbOfRptsAccptd&gt;1     &lt;/Tt1NbOfRptsAccptd&gt;     &lt;Tt1NbOfRptsRjctd&gt;0     &lt;/Tt1NbOfRptsRjctd&gt;   &lt;/RptSttstcs&gt;   &lt;DerivSttstcs&gt;     &lt;DtldSttstcs&gt;       &lt;Tt1NbOfTx&gt;10       &lt;/Tt1NbOfTx&gt;       &lt;Tt1NbOfTxAccptd&gt;9       &lt;/Tt1NbOfTxAccptd&gt;       &lt;Tt1NbOfTxRjctd&gt;1       &lt;/Tt1NbOfTxRjctd&gt;       &lt;TxRjctnsRsn&gt;         &lt;TxId&gt;           &lt;ActnTp&gt;NEWT&lt;/ActnTp&gt;           &lt;RptgTmStmp&gt;             2025-0407T10:00:00Z           &lt;/RptgTmStmp&gt;           &lt;DerivEvtTp&gt;TRAD           &lt;/DerivEvtTp&gt;           &lt;EvtTmStmp&gt;&lt;Dt&gt;             2025-04-07           &lt;/Dt&gt;&lt;/EvtTmStmp&gt;         &lt;/TxId&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;             ABCDEFGHIJKLMNOPQRST           &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;       &lt;/TxId&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         UTI1       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/TxId&gt;   &lt;/Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt; </pre> |
| 2   | Raġuni għar-rifjut                         | Kodiċi tal-iżball                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 3   | Deskrizzjoni tar-rifjut                    | Deskrizzjoni tal-iżball               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 4   | Numru ta' derivattivi riċevuti             | 10                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 5   | Numru ta' derivattivi aċċettati            | 9                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 6   | Numru ta' derivattivi rrifjutati           | 1                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 7   | Identifikazzjoni tad-derivattivi           |                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 8   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 9   | Kontroparti 2                              | ABCDEFGHIJKLMN<br>NOPQRST             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 10  | UTI                                        | UTI1                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 11  | Kronogramma tar-rapportar                  | 2025-04-07T10:00:00Z                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 12  | Data tal-event                             | 2025-04-07                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 13  | Tip ta' event                              | TRAD                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 14  | Tip ta' azzjoni                            | NEWT                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 15  | Stat Aċċettat                              | ACPT                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 16  | Stat Irrifjutat                            | RJCT                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 17  | Raġuni għar-rifjut                         | EMIR-VR-1001-6                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

**Tabella 90 - Feedback dwar ir-rifjut immedjat**

| Nru | Kamp                    | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                            |
|-----|-------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                         |                                       | <pre> &lt;DtldVldtnRule&gt;   &lt;Id&gt;EMIR-VR-1001-6&lt;/Id&gt;   &lt;Desc&gt;Xpath of the     Erroneous field&lt;/Desc&gt; &lt;/DtldVldtnRule&gt; &lt;/TxsrjctnsRsn&gt; &lt;/DtldSttstcs&gt; </pre> |
| 18  | Deskrizzjoni tar-rifjut | Xpath tal-kamp żbaljat                | ...                                                                                                                                                                                                    |

621. Jekk ir-rifjut ikun relatat mal-kamp 1.4 “Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)” jew mal-kamp 1.9 “Kontroparti 2”, dawn il-kampijiet jistgħu ma jimtlewx fir-rapport tar-rifjut.

#### 6.3.1.2 Rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata

622. Ir-rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata għandu jiġi pprovdut mit-TRs fil-messaġġi tar-rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022 f'konformità mal-Artikolu 4(1)(c) tal-RTS dwar il-kwalità tad-data, b'mod speċifiku l-iskema XSD. Għandu jinkludi din l-informazzjoni li ġejja:

**Tabella 91 - Rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp                                       | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-----|--------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Numru ta' fajls riċevuti                   | 3                                     | <pre> ... &lt;RjctnSttstcs&gt;   &lt;CtrPtyId&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;RptSubmitgNtty&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/RptSubmitgNtty&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;   &lt;/CtrPtyId&gt;   &lt;RptSttstcs&gt;     &lt;TtlNbOfRpts&gt;3&lt;/TtlNbOfRpts&gt;     &lt;TtlNbOfRptsAccptd&gt;2   &lt;/TtlNbOfRptsAccptd&gt; </pre> |
| 2   | Nru. ta' fajls aċċettati                   | 2                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 3   | Nru. ta' fajls irrifjutati                 | 1                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 4   | Identifikazzjoni tal-fajl                  | RAPPORT 1                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 5   | Raġuni għar-rifjut                         | CRPT                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 6   | Deskrizzjoni tar-rifjut                    | Fajl huwa korrott                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 7   | Numru ta' derivattivi riċevuti             | 10                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 8   | Numru ta' derivattivi aċċettati            | 9                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 9   | Numru ta' derivattivi rrifjutati           | 1                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 10  | Identifikazzjoni tad-derivattivi           |                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 11  | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta) | 12345678901234500000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |

**Tabella 91 - Rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp          | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----|---------------|---------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 12  | Kontroparti 2 | ABCDEFGHIJKLM<br>NOPQRST              | <pre> &lt;TtlNbOfRptsRjctd&gt;1 &lt;/TtlNbOfRptsRjctd&gt; &lt;NbOfRptsRjctdPerErr&gt;   &lt;DtldNb&gt;1&lt;/DtldNb&gt;   &lt;RptSts&gt;     &lt;MsgRpId&gt;REPORT1&lt;/MsgRpId&gt;     &lt;Sts&gt;CRPT&lt;/Sts&gt;   &lt;/RptSts&gt; &lt;/NbOfRptsRjctdPerErr&gt; &lt;/RptSttstcs&gt; &lt;DerivSttstcs&gt;   &lt;DtldSttstcs&gt;     &lt;TtlNbOfTx&gt;10     &lt;/TtlNbOfTx&gt;     &lt;TtlNbOfTxAccptd&gt;9     &lt;/TtlNbOfTxAccptd&gt;     &lt;TtlNbOfTxRjctd&gt;1     &lt;/TtlNbOfTxRjctd&gt;     &lt;TxRjctnsRsn&gt;       &lt;TxId&gt;         &lt;ActnTp&gt;NEW&lt;/ActnTp&gt;         &lt;RptgTmStmp&gt;           2025-0407T10:00:00Z         &lt;/RptgTmStmp&gt;         &lt;DerivEvtTp&gt;TRAD         &lt;/DerivEvtTp&gt;         &lt;EvtTmStmp&gt;&lt;Dt&gt;           2025-04-07         &lt;/Dt&gt;&lt;/EvtTmStmp&gt;         &lt;OthrCtrPty&gt;           &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;             ABCDEFGHIJKLMNOPQRST           &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;         &lt;TxId&gt;           &lt;UnqTxIdr&gt;             UTI1           &lt;/UnqTxIdr&gt;         &lt;/TxId&gt;         &lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt;         &lt;DtldVldtnRule&gt;           &lt;Id&gt;EMIR-VR-1001-6&lt;/Id&gt;           &lt;Desc&gt;Xpath of the             erroneous field&lt;/Desc&gt;           &lt;/DtldVldtnRule&gt;         &lt;/TxRjctnsRsn&gt;       &lt;/DtldSttstcs&gt; </pre> |
| 13  | UTI           | UTI1                                  | ...                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

**Tabella 91 - Rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp                      | Detalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML |
|-----|---------------------------|--------------------------------------|-------------|
| 14  | Kronogramma tar-rapportar | 2025-04-07T10:00:00Z                 |             |
| 15  | Data tal-event            | 2025-04-07                           |             |
| 16  | Tip ta' event             | TRAD                                 |             |
| 17  | Tip ta' azzjoni           | NEWT                                 |             |
| 18  | Status Aċċettat           | ACPT                                 |             |
| 19  | Status Irrifjutat         | RJCT                                 |             |
| 20  | Raġuni għar-rifjut        | EMIR-VR-1001-6                       |             |
| 21  | Deskrizzjoni tar-rifjut   | Xpath tal-kamp żbaljat               |             |

623. Jekk ir-rifjut ikun relatat mal-kamp 1.4 “Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)” jew mal-kamp 1.9 “Kontroparti 2”, dawn il-kampijiet jistgħu ma jimtlewx fir-rapport tar-rifjut.

624. Ir-rapport tar-rifjut tal-aħħar tal-ġurnata għandu jiġi pprovdut b'mod elettroniku fil-messaġġ XML ISO 20022. It-TRs jistgħu, barra minn hekk, jużaw interfaċċa oħra sabiex, eż. fil-każ li l-kontroparti li tirrapporta jew l-entità responsabbli mir-rapportar ma tkunx qed tirrapporta direttament lit-TR, iżda jkollha kont li minnu tista' tara biss, se jkun jista' jkollha fehim dettaljat dwar il-konformità tagħha mal-obbligu ta' rapportar skont l-EMIR.

### 6.3.2 Feedback ta' twissijiet

625. L-Artikolu 4(1)(e) sa 4(1)(g) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data* jeħtieġ lit-TRs jagħmlu disponibbli lill-kontropartijiet li jirrapportaw, lill-RSEs, lill-ERRs u lill-partijiet terzi li ngħataw aċċess għad-*data* tal-EMIR skont l-Artikolu 78(7) tar-rapporti tal-aħħar tal-ġurnata tal-EMIR dwar valwazzjonijiet neqsin ta' derivattivi pendenti, informazzjoni tal-marġni nieqsa tad-derivattivi pendenti, kif ukoll dwar valuri anormali rrapportati fil-kampijiet.

626. Dawn ir-rapporti tal-aħħar tal-ġurnata għandhom isiru aċċessibbli għall-entitajiet sa 6:00 UTC u għall-awtoritajiet sa 12:00 UTC fil-jum tax-xogħol ta' wara. Għad-determinazzjoni tal-jiem tax-xogħol, għandu jintuża l-kalendarju TARGET 2.

627. It-TRs għandhom jużaw id-*data* kollha li għabru biex jiddeterminaw liema informazzjoni għandhom jipprovdu u lil liema RSEs, ERRs u kontropartijiet.

628. L-inklużjoni tad-derivattivi fir-rapporti tal-feedback ta' twissijiet tal-aħħar tal-ġurnata għall-valwazzjonijiet neqsin u informazzjoni dwar il-marġni għandhom isegwu l-istess regoli bħall-inklużjoni tad-derivattivi fir-Rapport dwar l-Istat tan-Negożju kif deskritt fid-dettall fit-taqsima 6.1. Għalhekk, it-twissijiet għandhom jiġu

pprovduti abbażi ta' TSR u pereżempju derivattivi mejtin għandhom jiġu esklużi (kif spjegat fit-taqsima 6.1.7).

629. L-inklużjoni tad-derivattivi fir-rapport ta' feedback ta' twissijiet tal-aħħar tal-ġurnata għal valuri anormali għandha minflok tkun ibbażata fuq it-TAR, fejn ir-rapporti riċevuti bit-tip ta' azzjoni "Ġdid", "Komponent ta' pożizzjoni", "Modifika" jew "Korrezzjoni" għandhom jintużaw għal dan l-iskop.
630. In-numru ta' derivattivi inklużi fir-rapporti ta' feedback ta' twissijiet għandu jiġi vvalutat mill-perspettiva tal-kontroparti 1.
631. Rapporti ta' feedback ta' twissijiet tal-aħħar tal-ġurnata dwar valwazzjonijiet neqsin u informazzjoni dwar il-marġni għandhom jeskludu rapporti dwar il-kontropartijiet li mhumex obbligati jippreżentaw valwazzjonijiet ta' kuljum u informazzjoni dwar il-marġni dwar id-derivattivi pendenti. L-identifikazzjoni ta' dawn ir-rekords li ma jidhrlux fil-kamp tal-applikazzjoni għandha tinkiseb billi jiġu ffiltrati l-kamp 1.5 "Natura tal-kontroparti 1" = "N" u l-kamp 1.7 "Limitu tal-ikklerjar tal-kontroparti 1" = "Falz". Barra minn hekk, ir-rapport ta' feedback ta' twissijiet dwar l-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa għandu jeskludi negozji mhux kollateralizzati. L-identifikazzjoni tar-rekords mhux kollateralizzati barra mill-kamp tal-applikazzjoni għandha tinkiseb billi jiġi ffiltrat il-kamp 3.11 "Kategorija ta' kollateralizzazzjoni" = "UNCL".
632. it-TRs għandhom jipprovdu d-*data* rilevanti fil-kamp ta' applikazzjoni għar-rapporti ta' feedback ta' twissijiet lill-RSEs rilevanti, u lill-ERRs u lill-kontropartijiet kollha kif applikabbli.
633. Rapporti tal-aħħar tal-ġurnata li jipprovdu informazzjoni dwar *data* nieqsa jew anormali ma jinkludux rapporti dwar ir-rifjut tad-derivattivi, huma ta' natura informattiva u għandhom jipprovdu twissijiet dwar diffetti possibbli fir-rapportar lill-partijiet rilevanti. Madankollu, minkejja n-natura informattiva, il-kontropartijiet li jirrapportaw, l-ERRs u l-RSEs kif applikabbli għandhom dejjem jinvestigaw il-problemi identifikati u jekk rapportar hażin jiġi kkonfermat, id-*data* għandha titrangà jew d-*data* nieqsa tiġi rrapportata mingħajr dewmien bla bżonn.
634. Rigward id-dati tal-għeluq għall-provvista ta' rapporti ta' feedback ta' twissijiet tal-aħħar tal-ġurnata taħt ċirkostanzi speċjali, bħal manutenzjoni ppjanata jew mhux ippjanata, it-TRs għandhom jipproċedu b'mod analoġu mal-gwida eżistenti dwar l-aspetti operattivi dwar l-aċċess għad-*data*, inkluż fit-taqsima 6.4.1.
635. Rapporti ta' feedback ta' twissijiet tal-aħħar tal-ġurnata għandhom jiġu pprovduti b'mod elettroniku fil-messaġġi ta' rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022. It-TRs jistgħu, barra minn hekk, jużaw interfaċċa oħra sabiex, eż. fil-każ li l-kontroparti li tirrapporta jew l-entità responsabbli mir-rapportar ma tkunx qed tirrapporta direttament lit-TR, iżda jkollha kont li minnu tista' tara biss, se jkun jista' jkollha fehim dettaljat dwar il-konformità tagħha mal-obbligu ta' rapportar skont l-EMIR Refit.

### 6.3.2.1 Rapport ta' valwazzjonijiet neqsin

636. Skont l-Artikolu 4(1)(e) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, id-derivattivi pendenti li għalihom l-ebda valwazzjoni ma giet rapportata, jew il-valwazzjoni li giet rapportata tkun datata iktar minn erbatax-il jum kalendarju qabel il-ġurnata li għaliha r-rapport huwa ġġenerat għandhom jiġu inklużi fir-rapport tal-valwazzjonijiet neqsin tal-aħħar tal-ġurnata. Biex jipprovdu l-feedback tal-valwazzjonijiet neqsin, it-TRs għandhom jużaw bhala referenza t-TSR iġġenerat f'konformità mat-taqsim 6.1.

637. Għalhekk, dan ir-rapport għandu jinkludi:

- a) kwalunkwe derivattiv pendenti fil-kamp ta' applikazzjoni tar-rekwiżiti tar-rapportar tal-valwazzjoni li għalih il-kamp 2.21 "Ammont tal-valwazzjoni" qatt ma gie rapportat kif ukoll
- b) kwalunkwe derivattiv pendenti fil-kamp ta' applikazzjoni tar-rekwiżiti tar-rapportar tal-valwazzjoni li għalih il-kamp 2.21 "Ammont tal-valwazzjoni" gie rapportat mill-inqas darba, iżda l-valur l-iktar reċenti għal dan il-kamp, jiġifieri bl-iktar kamp 2.23 "kronogramma tal-valwazzjoni" reċenti, ikollu l-valur ta' din il-kronogramma iktar minn erbatax-il jum kalendarju qabel il-ġurnata li għalih ir-rapport huwa ġġenerat.

638. Rapport tal-valwazzjonijiet neqsin tal-aħħar tal-ġurnata pprovduti mit-TRs fil-messaġġi tar-rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022, b'mod speċifiku l-iskema XSD, għandu jkun fih l-informazzjoni speċifikata fit-Tabella 92.

**Tabella 92 - Rapport tal-valwazzjonijiet neqsin tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp                                                 | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----|------------------------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Numru ta' derivattivi pendenti                       | 10                                    | <pre> &lt;MsgValtn&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;NbOfOutsdngDerivs&gt;10   &lt;/NbOfOutsdngDerivs&gt;   &lt;NbOfOutsdngDerivsWithNoValtn&gt;1   &lt;/NbOfOutsdngDerivsWithNoValtn&gt;   &lt;NbOfOutsdngDerivsWithOutdtValtn&gt;0   &lt;/NbOfOutsdngDerivsWithOutdtValtn&gt;   &lt;Wrngs&gt;     &lt;CtrPtyId&gt;       &lt;RptgCtrPrty&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptgCtrPrty&gt;       &lt;RptSubmitgNtty&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptSubmitgNtty&gt;       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;     &lt;/CtrPtyId&gt;     &lt;NbOfOutsdngDerivs&gt;10   &lt;/NbOfOutsdngDerivs&gt;   &lt;NbOfOutsdngDerivsWithNoValtn&gt;1           </pre> |
| 2   | Numru ta' derivattivi pendenti bl-ebda valwazzjoni   | 1                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 3   | Numru ta' derivattivi pendenti b'valwazzjoni skaduta | 0                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 4   | Identifikazzjoni tad-derivattivi                     |                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 5   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)           | 12345678901234500000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 6   | Kontroparti 2                                        | ABCDEFGHIJKLMN<br>NOPQRST             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 7   | UTI                                                  | UTI1                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 8   | Ammont tal-valwazzjoni                               | EUR 5,000,000                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 9   | Kronogramma tal-valwazzjoni                          | 2023-04-07T10:00:00Z                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <pre> &lt;/NbOfOutsdngDerivsWithNoValtn&gt; &lt;NbOfOutsdngDerivsWithOutdtValtn&gt;0 &lt;/NbOfOutsdngDerivsWithOutdtValtn&gt; &lt;TxDtls&gt;   &lt;TxId&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;         ABCDEFGHIJKLMNOPQRST       &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;UnqIdr&gt;       &lt;UnqTxIdr&gt;         UTI1       &lt;/UnqTxIdr&gt;     &lt;/UnqIdr&gt;   &lt;/TxId&gt;   &lt;ValtnAmt&gt;&lt;Amt Ccy="EUR"&gt;5000000 &lt;/Amt&gt;&lt;/ValtnAmt&gt; &lt;ValtnTmStmp&gt;   2023-04-07T10:00:00Z &lt;/ValtnTmStmp&gt; &lt;/TxDtls&gt; &lt;/Wrngs&gt; &lt;/MssngValtn&gt; </pre> |
|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

#### 6.3.2.2 Rapport ta' informazzjoni dwar il-marġni nieqsa

639. Skont l-Artikolu 4(1)(F) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, id-derivattivi pendenti li għalihom l-ebda informazzjoni dwar il-marġni ma giet rapportata, jew l-informazzjoni dwar il-marġni li giet rapportata tkun datata iktar minn erbatax-il jum kalendarju qabel il-ġurnata li għaliha r-rapport huwa ġġenerat għandhom jiġu inklużi fir-rapport tal-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa tal-aħħar tal-ġurnata. Biex jipprovdu l-feedback tal-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa, it-TRs għandhom jużaw bħala referenza t-TSR iġġenerat f'konformità mat-taqsim 6.1.

640. Għalhekk, dan ir-rapport għandu jinkludi:

- kwalunkwe derivattiv pendenti fil-kamp ta' applikazzjoni tar-rekwiżiti tar-rapportar tal-marġni li għalih ir-rapport tal-marġni qatt ma gie rapportat bit-tip ta' azzjoni "MARU" għall-UTI partikolari (jew gie rapportat iżda mbagħad il-UTI bil-marġni korrispondenti kien żbaljat u l-ebda informazzjoni dwar il-marġni ma giet irrapportata wara l-ftuħ mill-ġdid tad-derivattiv) u
- kwalunkwe derivattiv pendenti fil-kamp ta' applikazzjoni tar-rekwiżiti tar-rapportar tal-marġni li għalihom ir-rapport tal-marġni gie rapportat mill-inqas darba, iżda l-iktar rapport reċenti, jiġifieri bl-iktar kamp 3.7 "kronogramma tal-kollateral" reċenti, ikollu l-valur tad-*data* ta' din il-kronogramma iktar minn erbatax-il jum kalendarju qabel il-ġurnata li għalih ir-rapport gie ġġenerat.

641. Rapport tal-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa tal-aħħar tal-ġurnata pprovdut mit-TRs fil-messaġġi tar-rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022, b'mod speċifiku l-iskema XSD, għandu jkun fih l-informazzjoni inkluża fit-tabella ta' hawn taħt.

**Tabella 93 - Rapport tal-informazzjoni dwar il-marġni nieqsa tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp                                                                  | Dettagli li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|-----------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Numru ta' derivattivi pendenti                                        | 10                                    | <MssngMrnInf><br><Rpt><br><NbOfOutsdngDerivs>10<br></NbOfOutsdngDerivs><br><NbOfOutsdngDerivsWithNoMrnInf>1<br></NbOfOutsdngDerivsWithNoMrnInf><br><NbOfOutsdngDerivsWithOutdtMrnInf>0<br></NbOfOutsdngDerivsWithOutdtMrnInf><br><Wrngs><br><CtrPtyId><br><RptgCtrPty><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></RptgCtrPty><br><RptSubmitgNtty><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></RptSubmitgNtty><br><NttyRspnsblForRpt><br><LEI>12345678901234500000</LEI><br></NttyRspnsblForRpt><br></CtrPtyId><br><NbOfOutsdngDerivs>10<br></NbOfOutsdngDerivs><br><NbOfOutsdngDerivsWithNoMrnInf>1<br></NbOfOutsdngDerivsWithNoMrnInf><br><NbOfOutsdngDerivsWithOutdtMrnInf>0<br></NbOfOutsdngDerivsWithOutdtMrnInf><br><TxDtls><br><TxId><br><OthrCtrPty><br><Lgl><LEI><br>ABCDEFGHIJKLMNQRST<br></LEI></Lgl><br></OthrCtrPty><br><UnqIdr><br><UnqTxIdr><br>UTI1<br></UnqTxIdr><br></UnqIdr><br></TxId><br><CollTmStmp><br>2023-04-07T10:00:00Z<br></CollTmStmp><br></TxDtls><br></Wrngs><br></MssngMrnInf> |
| 2   | Numru ta' derivattivi pendenti bl-ebda informazzjoni dwar il-marġni   | 1                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 3   | Numru ta' derivattivi pendenti b'informazzjoni dwar il-marġni skaduta | 0                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 4   | Identifikazzjoni tad-derivattivi                                      |                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 5   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)                            | 12345678901234500000                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 6   | Kontroparti 2                                                         | ABCDEFGHIJKLMNQRST                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 7   | UTI                                                                   | UTI1                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 8   | Kronogramma tal-kollateral                                            | 2023-04-07T10:00:00Z                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

### 6.3.2.3 Rapporti tal-valuri anormali

642. Skont l-Artikolu 4(1)(g) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, id-derivattivi li waslu bit-tip ta' azzjoni "Ġdid", "Komponent ta' pożizzjoni", "Modifika" jew "Korrezzjoni" li l-ammont nozzjonali tagħhom ikun ikbar minn limitu għal dik il-klassi tad-derivattivi għandhom jiġu inklużi fir-rapport tal-valuri anormali tal-aħħar tal-ġurnata.
643. Ir-rapporti tad-derivattivi li jaslu fil-jum tax-xogħol qabel il-jum tax-xogħol meta l-feedback jiġi ġġenerat sa 6 a.m. UTC għandhom jiġu inklużi fir-rapporti ta' feedback ta' twissijiet għall-ġurnata partikolari. Jekk it-TR taċċetta wkoll sottomissjonijiet f'jiem li ma jkunux tax-xogħol, ir-rapport ta' feedback ta' twissijiet għandu jinkludi wkoll rapporti ppreżentati li jkunu waslu f'jiem li mhumie x tax-xogħol qabel il-jum tax-xogħol meta l-feedback huwa ġġenerat (eż. għat-Tnejn sottomissjonijiet tar-rapport ta' feedback ta' twissijiet li waslu l-Ġimgħa, is-Sibt u l-Ħadd).
644. Valuri anormali (outliers) għandhom jiġu identifikati għall-kampijiet li ġejjin:
- c. 2.55 "Ammont nozzjonali tal-komponent 1",
  - d. 2.59 "Ammont nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 1",
  - e. 2.60 "Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 1",
  - f. 2.63 "Kwantità nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 1",
  - g. 2.64 "Ammont nozzjonali tal-komponent 2",
  - h. 2.68 "Ammont nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 2",
  - i. 2.69 "Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 2",
  - j. 2.72 "Kwantità nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 2".
645. Rapport tad-derivattiv għandu jiġi inkluż fir-rapport ta' feedback ta' twissijiet meta mill-inqas wiehded mill-kampijiet elenkati mtela b'valur anormali. Jekk ir-rapport tad-derivattiv fih valuri anormali għal iktar minn kamp wiehded, dawn il-valuri anormali kollha għandhom jiġu indikati fil-feedback.
646. Il-valuri ta' dawn il-kampijiet għandhom jiġu konvertiti fl-ammonti ewkivalenti f'EUR għall-iskop tad-detezzjoni tal-valuri anormali.
647. Il-valuri anormali għandhom jiġu identifikati għal kull klassi u kull livell tad-derivattivi (kreditu, komodità, munita, ekwità, rati tal-imgħax), kif kategorizzati mill-kamp 2.11 "Klassi tal-assi", u mill-kamp 2.154 "Livell" separatament.
648. Sabiex tiġi żgurata l-konformità mal-Artikolu 4(1)(g) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, it-TR għandu jinforma lill-ESMA bil-metodu tad-detezzjoni tal-outlier magħżul u l-limiti applikati għal dak il-metodu partikolari.

649. It-TR għandu wkoll jagħmel l-informazzjoni dwar il-metodu tad-detezzjoni tal-outlier u l-limiti disponibbli lill-entitajiet rilevanti li qed jirċievu r-rapporti tal-valuri anormali tal-aħħar tal-ġurnata, sabiex ikunu informati bis-sħiħ dwar il-kontenut ta' dawn ir-rapporti.

650. Ir-rapport tal-valuri anormali tal-aħħar tal-ġurnata mit-TRs fil-messaġġi tar-rispons standardizzati f'konformità mal-format ISO 20022, b'mod speċifiku l-iskema XSD, għandu jinkludi l-informazzjoni inkluża fit-tabella ta' hawn taħt.

**Tabella 94 - Rapport tal-valuri anormali tal-aħħar tal-ġurnata**

| Nru | Kamp                                                        | Detalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----|-------------------------------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1   | Numru ta' derivattivi rrapportati b'NEWT, POSCO, MODI, CORR | 10                                   | <pre> &lt;AbnrmlVals&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;NbOfDerivsRptd&gt;10   &lt;/NbOfDerivsRptd&gt;   &lt;NbOfDerivsRptdWthOtlrs&gt;1   &lt;/NbOfDerivsRptdWthOtlrs&gt;   &lt;Wrngs&gt;     &lt;CtrPtyId&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;RptSubmitgNtty&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptSubmitgNtty&gt;       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;     &lt;/CtrPtyId&gt;     &lt;NbOfDerivsRptd&gt;10   &lt;/NbOfDerivsRptd&gt;   &lt;NbOfDerivsRptdWthOtlrs&gt;1   &lt;/NbOfDerivsRptdWthOtlrs&gt;   &lt;TxDtls&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;ActnTp&gt;NEWT&lt;/ActnTp&gt;       &lt;RptgTmStmp&gt;         2025-0407T10:00:00Z       &lt;/RptgTmStmp&gt;       &lt;DerivEvtTp&gt;TRAD       &lt;/DerivEvtTp&gt;       &lt;DerivEvtTmStmp&gt;&lt;Dt&gt;         2025-04-07       &lt;/Dt&gt;&lt;/DerivEvtTmStmp&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;           ABCDEFGHIJKLMNOPQRST         &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;       &lt;/OthrCtrPty&gt; </pre> |
| 2   | Numru ta' derivattivi rrapportati b'outliers                | 1                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 3   | Identifikazzjoni tad-derivattivi                            |                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 4   | Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)                  | 12345678901234500000                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 5   | Kontroparti 2                                               | ABCDEFGHIJKLMN<br>NOPQRST            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 6   | UTI                                                         | UTI1                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|    |                                                                           |                                                       |
|----|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
|    |                                                                           |                                                       |
| 7  | Kronogramma tar-rapportar                                                 | 2025-04-07T10:00:00Z                                  |
| 8  | Data tal-event                                                            | 2025-04-07                                            |
| 9  | Tip ta' event                                                             | TRAD                                                  |
| 10 | Tip ta' azzjoni                                                           | NEWT                                                  |
| 11 | Ammont nozzjonali tal-komponent 1                                         | Kamp 2.55 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 12 | Ammont nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 1   | Kamp 2.59 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 13 | Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 1                                | Kamp 2.60 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 14 | Kwantità nozzjonali fis-sehħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 1 | Kamp 2.63 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 15 | Ammont nozzjonali tal-komponent 2                                         | Kamp 2.64 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |

```

<TxId>
  <UnqTxIdr>
    UTI1
  </UnqTxIdr>
</TxId>
<NtnlAmt>
  <FrstLeg>
    <Amt>
      <Amt Ccy="EUR">10000</Amt>
    </Amt>
    <SchdlPrd>
      <Amt>
        <Amt Ccy="EUR">10000</Amt>
      </Amt>
    </SchdlPrd>
  </FrstLeg>
  <ScndLeg>
    <Amt>
      <Amt Ccy="GBP">3000</Amt>
    </Amt>
    <SchdlPrd>
      <Amt>
        <Amt Ccy="EUR">3000</Amt>
      </Amt>
    </SchdlPrd>
  </ScndLeg>
</NtnlAmt>
</TxDtls>
</Wrngs>
</AbnrmlVals>

```

|    |                                                                           |                                                       |
|----|---------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 16 | Ammont nozzjonali fis-seħħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 2   | Kamp 2.68 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 17 | Kwantità nozzjonali totali tal-komponent 2                                | Kamp 2.69 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |
| 18 | Kwantità nozzjonali fis-seħħ fid-data effettiva assoċjata tal-komponent 2 | Kamp 2.72 jew vojt jekk l-ebda outlier ma jiġi detett |

### 6.3.3 Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni

651. Fit-Tabella 3 tal-Anness għall-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, l-ESMA inkludiet kategoriji differenti ta' statuses għal derivattiv, kif ġej:

| Tabella 95                                       |                                |
|--------------------------------------------------|--------------------------------|
| Kategoriji ta' rikonċiljazzjoni                  | Valuri permessi                |
| Rekwiżit tar-rapportar għaż-żewġ kontropartijiet | Iva/Le                         |
| Tip ta' rapportar                                | Naħa waħda/Żewġ naħat          |
| Formazzjoni f'par                                | Ippariġġati/Mhux ippariġġati   |
| Rikonċiljazzjoni                                 | Rikonċiljata/Mhux rikonċiljata |
| Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni                 | Rikonċiljata/Mhux rikonċiljata |
| Ftuħ mill-ġdid                                   | Iva/Le                         |
| Modifiki ulterjuri:                              | Iva/Le                         |

652. Il-kategorija “Rekwiżit tar-rapportar għaż-żewġ kontropartijiet” għandha timtela mit-TR abbażi tal-informazzjoni fil-kamp 1.14. Jekk il-kamp jimtela “Veru”, mela l-istatus tal-kategorija ta' rikonċiljazzjoni għandu jkun “Iva”, inkella għandu jkun “Le”.

653. Il-kategorija “Tip ta' rapportar” għandha timtela b’“Naħa waħda” meta t-TR ikun irċieva biss naħa waħda tad-derivattivi, u “Żewġ naħat” meta ż-żewġ kontropartijiet irrapportaw lill-istess TR.

654. Il-kategorija “Formazzjoni f'par” għandha timtela b’“Ippariġġati” meta t-TR ikun irnexxielu jidentifika ż-żewġ naħat tal-istess derivattiv jew “Mhux ippariġġati” meta ma jkunx għadu rnexxielu jagħmel dan. Meta TR jidentifika derivattiv bħala “Żewġ naħat” fil-kategorija “Tip ta' rapportar”, għandu jidentifikah biss bħala “Ippariġġat” fil-kategorija “Formazzjoni f'par”.

655. Id-derivattivi li ġew ippariġġati biss jistgħu jiġu rikonċiljati. Għalhekk, l-istatus ta' “Rikonċiljat” għall-kategorija “Rikonċiljazzjoni” jew għall-kategorija “Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni” għandu jiġi assenjat biss mit-TR għad-derivattivi li huma “Ippariġġati”.

656. It-TRs għandhom iqisu li l-aġġornamenti tal-valwazzjoni għan-negożji ETD jiġu rapportati fil-livell tal-pożizzjoni u li NFC- mhumex obbligati jipprezentaw aġġornamenti tal-valwazzjoni għad-derivattivi tagħhom. Dawn il-każijiet għandhom jiġu mmarkati fl-iskema bħala “Mhux applikabbli” minflok jiġu kategorizzati bħala “Mhux rikonċiljati”.
657. It-TRs għandhom jidentifikaw bħala “Rikonċiljati” biss dawk id-derivattivi li għalihom il-kampijiet rikonċiljabbli kollha huma fi ħdan it-tolleranzi permessi ta’ rikonċiljazzjoni.
658. Finalment, il-mili tal-kategoriji “Ftuħ mill-ġdid” u “Modifiki ulterjuri” huwa indipendenti mill-bqija tal-kategoriji ta’ rikonċiljazzjoni. Il-kategorija “Modifiki ulterjuri” għandha tiġi stabbilita bħala “Iva” meta jasal avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja apparti “NEW” u dan il-valur għandu jinżamm sakemm il-kuntratt tad-derivattiv aġġornat jiġi rikonċiljat. Il-kategorija “Ftuħ mill-ġdid” għandha tiġi stabbilita għal “Iva” meta jasal avveniment taċ-ċiklu tal-ħajja “REVI” u dan il-valur għandu jinżamm sakemm il-kuntratt tad-derivattiv ma jibqax pendent.
659. Fit-tabella inkluża hawn taħt, hemm il-kombinamenti kollha permessi. It-TRs għandhom jużaw biss il-kombinamenti ta’ hawn taħt meta jipprovdu l-feedback dwar ir-ikonċiljazzjoni.

| Tabella 96                                       |                   |                   |                  |                                   |                |                    |
|--------------------------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|-----------------------------------|----------------|--------------------|
| Rekwiżit tar-rapportar għaž-żewġ kontropartijiet | Tip ta’ rapportar | Formazzjoni f’par | Rikonċiljazzjoni | Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni* | Ftuħ mill-ġdid | Modifiki ulterjuri |
| Le                                               | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Le                                               | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |
| Le                                               | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Le                                               | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Mhux ippariġġat   | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |

**Tabella 96**

| Rekwiżit tar-rapportar għaż-żewġ kontropartijiet | Tip ta' rapportar | Formazzjoni f'par | Rikonċiljazzjoni | Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni* | Ftuħ mill-ġdid | Modifiki ulterjuri |
|--------------------------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|-----------------------------------|----------------|--------------------|
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Naħa waħda        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Mhux rikonċiljat                  | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Iva            | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Le             | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Rikonċiljat      | Rikonċiljat                       | Iva            | Iva                |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Le             | Le                 |
| Iva                                              | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Iva            | Le                 |

| Tabella 96                                                                        |                   |                   |                  |                                   |                |                    |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-------------------|-------------------|------------------|-----------------------------------|----------------|--------------------|
| Rekwiżit tar-rapportar għaż-żewġ kontropartijiet                                  | Tip ta' rapportar | Formazzjoni f'par | Rikonċiljazzjoni | Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni* | Ftuħ mill-ġdid | Modifiki ulterjuri |
| Iva                                                                               | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Le             | Iva                |
| Iva                                                                               | Żewġ naħat        | Akkoppjat         | Mhux rikonċiljat | Rikonċiljat                       | Iva            | Iva                |
| * Għandu jimtela f'ċerti każijiet bħala "Mhux applikabbli" skont il-paragrafu 656 |                   |                   |                  |                                   |                |                    |

### 6.3.3.1 Feedback immedjat

660. Meta jiġi pprovdut feedback immedjat dwar ir-rikonċiljazzjoni f'konformità mal-Artikolu 3(5) tal-RTS dwar il-kwalità tad-data, it-TRs għandhom jipprovdu informazzjoni biss dwar dawk id-derivattivi li ġew soġġetti għar-rikonċiljazzjoni fiċ-ċiklu ta' rikonċiljazzjoni rilevanti.

661. L-informazzjoni li ġejja għandha tiġi inkluża fil-feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni:

| Tabella 97 - Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni |                                                  |                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------------------------------------------------|--------------------------------------------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Nru                                            | Kamp                                             | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 1                                              | Kontroparti li tirrapporta                       | 12345678901234500000                  | <pre> &lt;Rpt&gt; ... &lt;RcncltnCtgrs&gt;   &lt;RptgRqrmnt&gt;     &lt;RptgTp&gt;TWOS&lt;/RptgTp&gt;     &lt;Paing&gt;PARD&lt;/Paing&gt;     &lt;Rcncltn&gt;RECO&lt;/Rcncltn&gt;     &lt;ValtnRcncltn&gt;RECO   &lt;/ValtnRcncltn&gt;   &lt;Rvvd&gt;true&lt;/Rvvd&gt;  &lt;FrthrMod&gt;true&lt;/FrthrMod&gt;   &lt;/RptgRqrmnt&gt; &lt;/RcncltnCtgrs&gt; &lt;Tt1NbOfTx&gt;10&lt;/Tt1NbOfTx&gt; &lt;TxDtls&gt;   &lt;CtrPtyId&gt;     &lt;RptgCtrPrty&gt;       &lt;LEI&gt;         12345678901234500000       &lt;/LEI&gt;     &lt;/RptgCtrPrty&gt;     ...   &lt;/CtrPtyId&gt;   &lt;Tt1NbOfTx&gt;10&lt;/Tt1NbOfTx&gt;   &lt;RcncltnRpt&gt; </pre> |
| 2                                              | UTI                                              | Kamp 2.1                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 3                                              | Kontroparti oħra                                 | Kamp 1.11                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 4                                              | Rekwiżit tar-rapportar għaż-żewġ kontropartijiet | Veru                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 5                                              | Tip ta' rapportar                                | Żewġ naħat                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 6                                              | Formazzjoni f'par                                | Akkoppjat                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 7                                              | Rikonċiljazzjoni                                 | Rikonċiljat                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 8                                              | Rikonċiljazzjoni tal-valwazzjoni                 | Rikonċiljat                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 9                                              | Ftuħ mill-ġdid                                   | Veru                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 10                                             | Modifiki ulterjuri                               | Veru                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

**Tabella 97 - Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni**

| Nru | Kamp | Dettalji li għandhom jiġu rrapportati | Messaġġ XML                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|------|---------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |      |                                       | <pre> &lt;TxId&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;     &lt;Lgl&gt;&lt;LEI&gt;       ABCDEFGHIJKLMNOPQRST     &lt;/LEI&gt;&lt;/Lgl&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;UnqIdr&gt;     &lt;UnqTxIdr&gt;       UTI1     &lt;/UnqTxIdr&gt;   &lt;/UnqIdr&gt; &lt;/TxId&gt;   &lt;MtchgCrit&gt;    ... &lt;/MtchgCrit&gt; &lt;/RcncltnRpt&gt; &lt;/TxDtls&gt; &lt;/Rpt&gt; </pre> |

#### 6.3.3.2 Informazzjoni ta' rikonċiljazzjoni tal-aħħar tal-ġurnata

662. Meta jipprovdi informazzjoni ta' rikonċiljazzjoni tal-aħħar tal-ġurnata inkluża fl-Artikolu 4(1)(d) tal-RTS dwar il-kwalità tad-*data*, it-TR għandu jipprovdi informazzjoni dwar id-derivattivi kollha li huma fil-kamp ta' applikazzjoni tal-proċess tar-rikonċiljazzjoni.

## 6.4 Aċċess għad-*data*

### 6.4.1 Aspetti operattivi

663. Meta jipprovdu aċċess għad-*data* dwar it-tranzazzjoni f'konformità mal-Artikolu 2 tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*, it-TRs għandhom jinkludu d-dettalji kollha tad-derivattivi, irrISPettivament minn jekk ir-rapport għal derivattiv ġie aċċettat jew irrifjutat mit-TR. Iktar kjarifiki għar-rekwiżit fl-RTS dwar l-aċċess għad-*data* huma pprovduti bil-paragrafi ta' hawn taħt.

664. Awtorità kompetenti tal-Unjoni (inkluż l-awtoritajiet kompetenti tal-Istati Membri tal-UE) għandha aċċess għad-*data* kollha dwar it-tranzazzjoni fuq id-derivattivi kollha konkluzi minn kontroparti li taqa' fil-kamp ta' applikazzjoni ta' dik l-awtorità, fejn tali kontroparti tkun rapportata fil-kamp 1.4 "Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)" jew fil-kamp 1.9 "Kontroparti 2").

665. Awtorità kompetenti minn Stat Membru għandha aċċess għad-*data* kollha dwar it-tranzazzjoni fuq id-derivattivi kollha konkluzi minn kontroparti li tkun mill-istess

Stat Membru, fejn dawn l-awtoritajiet kompetenti għandhom jiġu pprovduti b'aċċess għad-*data* f'konformità mal-Artikolu 81(3) tal-EMIR.

666. L-awtoritajiet tat-titoli u tas-swieq tal-Unjoni, kif imsemmija fl-Artikolu 81(3)(j) tal-EMIR, għandhom jingħataw aċċess għad-*data* kollha dwar it-tranżazzjoni fuq id-derivattivi meta tkun l-Awtorità Kompetenti Rilevanti (RCA) skont l-FIRDS jew b'rabta mad-derivattiv innifsu (kamp 2.7) jew mas-sottostanti (kamp 2.14). Peress li l-RCA tista' tinbidel maż-żmien, ir-repożitorji tat-tranżazzjonijiet huma mistennija jipprovdu aċċess lill-awtorità maħtura bħala RCA fil-ħin li r-rapport ġie ġġenerat.
667. L-awtoritajiet tat-titoli u tas-swieq tal-Unjoni, kif imsemmija fl-Artikolu 81(3)(j) tal-EMIR, għandhom jingħataw aċċess għad-*data* kollha dwar it-tranżazzjoni fuq id-derivattivi fejn il-kamp "Tip ta' identifikazzjoni tas-sottostanti" (kamp 2.13) ikun rapportat b'"X" jew "B" u l-kamp "Identifikazzjoni tas-sottostanti" (kamp 2.14) jimtela bi:
- I-ISIN tal-indiċi sottostanti jew ISIN li jappartjeni lil kwalunkwe mill-komponenti individwali tal-basket sottostanti, li l-ewwel żewġ ittri tiegħu jirrappreżentaw il-kodiċi tal-pajjiż ta' dik l-awtorità kompetenti, jew ISIN li jappartjeni lil kwalunkwe mill-komponenti individwali ta' basket sottostanti, fejn l-Awtorità Kompetenti Rilevanti (RCA) kif determinata fil-bażi tad-*data* FIRDS hija tkun l-awtorità kompetenti, jew
  - I-ISIN tal-indiċi sottostanti jew ISIN li jappartjeni lil kwalunkwe mill-komponenti individwali tal-basket sottostanti tal-indiċi, li l-ewwel żewġ ittri tiegħu ma jirrappreżentawx il-kodiċi tal-pajjiż ta' dik l-awtorità kompetenti, iżda huwa meħtieġ sabiex dik l-awtorità twettaq ir-responsabbiltajiet u l-mandati tagħha, jew
  - I-ismijiet sħaħ jew il-kodiċijiet b'4 ittri standardizzati ta' indiċi addizzjonali li, minkejja li mhumex identifikati mill-ISIN, huma meħtieġa sabiex dik l-awtorità twettaq ir-responsabbiltajiet u l-mandati tagħha.
668. F'dak ir-rigward, kull awtorità kompetenti tista' tipprovdi lill-ESMA lista aġġornata tal-ISINs u/jew l-ismijiet sħaħ (assenjati mill-fornituri tal-indiċi) tal-indiċi addizzjonali u/jew indikaturi tal-indiċi sottostanti li għalihom dik l-awtorità teħtieġ ukoll aċċess għad-*data* dwar it-tranżazzjoni jekk indiċi partikolari jiġi identifikat fir-rapport bħala l-indiċi sottostanti jew komponent tal-basket sottostanti jew lista bi prinċipji, eż. derivattivi li jirreferu għall-azzjonijiet maħruġa fi stat membru jekk lista dettaljata ta' tipi ta' derivattivi jew sottostanti ma tkunx fattibbli u tista' tirriżulta f'restrizzjoni mhux meħtieġa ta' aċċess għad-*data*. Dik il-lista għandha tinżamm mill-ESMA, abbażi tal-informazzjoni pprovduta mill-awtoritajiet, u ssir disponibbli għar-Repożitorji tat-Tranżazzjonijiet. It-TRs għandhom jiffiltra l-lista tal-indiċi mingħajr ma jqisu d-distinzjoni bejn ittri kapitali u żgħar tal-karattri rapportati.
669. Mill-perspettiva tal-provvista tal-aċċess abbażi tal-UPI, it-TRs għandhom jagħmlu użu mill-informazzjoni disponibbli ppubblikata minn ANNA-DSB.
670. It-TRs għandhom jistabbilixxu l-aċċess għad-*data* tal-awtoritajiet tal-pajjiż terz f'konformità mal-Artikolu 3 tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*.

671. L-Artikolu 5(7) u 5(8) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data* ma jirreferix għall-iskedi ta' żmien li r-repożitorji tat-tranzazzjonijiet għandhom isegwu f'każ li jwettqu manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*, irrISPettivament mill-mezz jew mill-format użat.
672. Jenhtieg li t-TRs jippjanaw bir-reqqa l-manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data* sabiex ma taħbatx f'jiem ta' xogħol iddeterminati skont kalendarju maqbul b'mod konsistenti fl-Unjoni bħall-kalendarju TARGET 2. Fejn f'ċirkostanzi ta' eċċezzjoni din tkun taħbat f'jum ta' xogħol bħal dan, il-manutenzjoni skedata jenhtieg li ssir barra mill-ħinijiet normali tax-xogħol, jiġifieri kmieni ħafna filgħodu jew tard ħafna billejl. Jenhtieg li r-repożitorji tat-tranzazzjonijiet jiżguraw li l-manutenzjoni skedata msemija hawn fuq ma titwettaqx b'mod li tiġi evitata d-disponibbiltà puntwali ta' informazzjoni dwar id-derivattivi lill-awtoritajiet.
673. Jenhtieg li r-repożitorji tat-tranzazzjonijiet jużaw mezzi elettronici biex jinnotifikaw lill-awtoritajiet kollha bid-dati tal-bidu u tat-tmiem u bil-ħinijiet tal-manutenzjoni skedata tagħhom kemm jista' jkun teknikament possibbli malajr.
674. Fejn fit-TR ikun isir ippjanar annwali tal-ħinijiet tal-manutenzjoni skedata li jkollhom impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*, it-TR jenhtieg li jinnotifika lill-awtoritajiet kollha b'dak l-ippjanar fuq bażi annwali u b'avviż minn qabel ta' mill-inqas tliet ijiem ta' xogħol. Barra minn hekk, kwalunkwe notifika addizzjonali speċifika dwar manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*, li ma tiġix innotifikata fuq bażi annwali, jenhtieg li ssir mal-ewwel opportunità u mill-inqas tliet ijiem ta' xogħol qabel id-*data* tal-bidu tal-manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*.
675. Jenhtieg li r-repożitorji tad-*data* dwar it-tranzazzjonijiet iżommu rekord tan-notifiki rilevanti li jistgħu jsiru disponibbli għall-ESMA fuq talba. Ir-rekords relatati man-notifiki dwar manutenzjoni skedata jenhtieg li, mill-inqas, ikun fihom l-informazzjoni li ġejja: il-kronogramma tan-notifika, tal-bidu u tat-tmiem tal-manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data* u l-lista rilevanti tal-utenti nnotifikati.
676. Fil-każ tal-verifika tat-talbiet skont l-Artikolu 5(8) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*, jenhtieg li t-TRs jikkonfermaw li rċivew u jivverifikaw il-korrettezza u l-kompletezza ta' kwalunkwe talba għall-aċċess tad-*data*, mal-ewwel opportunità u mhux aktar tard minn sittin minuta wara l-finalizzazzjoni tal-manutenzjoni skedata rilevanti li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*.
677. Fil-każ ta' manutenzjoni mhux skedata, jenhtieg li t-TRs jirrispettaw l-iskedi ta' żmien inklużi fl-Artikoli 5(4) u 5(5) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data* u dawn l-iskedi ta' żmien jittieħdu bħala referenza meta tiġi vvalutata l-konformità tat-TR.
678. Ir-repożitorji tat-tranzazzjonijiet għandhom jinnotifikaw lill-ESMA u lill-entitajiet elenkati fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR li għandhom aċċess għad-*data* f'dak it-TR bil-manutenzjoni mhux ippjanata f'konformità mal-proċeduri tagħhom.

#### 6.4.2 Mudell tal-formola għall-aċċess għad-*data*

679. It-TRs għandhom jużaw il-mudell li ġej, ipprezentat tul is-sottosezzjonijiet ta' hawn taht biex jistabbilixxu l-aċċess għad-*data* dwar id-derivattivi skont l-Artikolu 4 tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*.
680. Peress li l-pożizzjonijiet u l-kompiti jistgħu jinbidlu, entità elenkata fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR għandha tistabbilixxi biss il-mandat tagħha, iżda mhux kwalunkwe informazzjoni dwar l-organizzazzjoni interna tagħha.
681. It-TRs għandhom jiżguraw rieżami regolari tal-aċċess għad-*data* għall-awtoritajiet, fuq bażi kostanti malli jsiru konxji ta' bidla u mill-inqas darba fis-sena u għandhom jaġġornaw l-aċċess għad-*data* f'konformità mal-istess skeda taż-żmien għall-konfigurazzjoni inizjali tal-aċċess skont l-Artikolu 4(1) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*.
682. Skont l-Artikolu 4(1)(d) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*, it-TRs għandhom jistabbilixxu l-aċċess għad-dettalji tad-*data* dwar it-tranżazzjoni fuq id-derivattivi għall-entitajiet elenkati fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR abbażi tal-informazzjoni pprovduta fil-formola msemija fl-Artikolu 4(2) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*. Huwa għalhekk importanti li l-informazzjoni pprovduta fil-formola tkun preċiża u kompleta kemm jista' jkun u għal dan l-għan, it-TRs huma mistennija jinvolvu ruħhom b'mod proattiv mal-awtoritajiet. B'mod partikolari, jekk TR, abbażi tal-informazzjoni li għabar u analizza, jemmen li hemm żbalji jew omissjonijiet fil-formola (pereżempju, mandat speċifiku ma ġiex immarkat minn awtorità), it-TR għandu jikkuntattja lill-awtorità u jikkonferma l-kamp ta' applikazzjoni tal-mandat tagħha, malli jkun fattibbli u bl-għan li tiġi żgurata l-provvista tal-aċċess skont l-iskeda ta' żmien stabbilita fl-Artikolu 4(1)(f) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*. It-TRs għandhom jagħmlu użu minn *data* disponibbli għall-pubbliku, pereżempju r-registri tal-ESMA għas-CCP u għaċ-ċentri tan-negozjar, biex jikkonfermaw l-informazzjoni inkluża mill-Awtoritajiet fil-formola tal-aċċess għad-*data* kif ukoll biex jimmonitorjaw kwalunkwe aġġornamenti potenzjali fil-mandati tagħhom.
683. Għall-provvista tal-aċċess lill-awtoritajiet skont l-Artikolu 81(3)(f) tal-EMIR, it-TRs għandhom jiġu pprovduti minn kull awtorità bil-lista tal-kodiċijiet MIC taht is-superviżjoni tagħha fil-formola tal-aċċess.
684. Il-lista tal-kampijiet tal-EMIR li għandhom jintużaw mit-TRs għall-iffiltrar tad-*data* għal kull wieħed mill-mandati elenkati fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR tinsab fit-Tabella 96 hawn taht. Jekk mill-inqas kamp wieħed ikun fih informazzjoni li abbażi tagħha jista' jiġi determinat jekk l-awtorità hijiex intitolata li tircievi d-*data*, mela din id-*data* għandha ssir disponibbli għal din l-awtorità.
685. Fir-rigward tal-aċċess għad-*data* tal-pożizzjoni kkalkolat, kull kamp regolatorju speċifiku għandu jintuża mit-TRs biex jiddeterminaw liema *data* tal-pożizzjoni għandha ssir disponibbli għall-awtoritajiet, eż. bil-munita. Biex jistabbilixxu l-aċċess għad-derivattivi rapportati fil-livell tal-pożizzjoni, it-TRs għandhom isegwu l-istess regoli bħal għad-derivattivi rapportati fil-livell tat-tranżazzjoni.

686. Fir-rigward tal-offerti ta' akkwizzizzjoni, it-TRs għandhom jieħdu d-*data* relatata mal-partijiet kollha involuti bħala eż. fl-offerti ta' akkwizzizzjoni / offerti / titoli kif definiti fl-Artikolu 2 tad-Direttiva 2004/25/KE.

#### 6.4.2.1 Informazzjoni ta' kuntatt

**TABELLA 98**

| Informazzjoni dwar ir-Regolatur u l-Firmatarju awtorizzat   |  |
|-------------------------------------------------------------|--|
| Isem sħiħ tal-entità (bi traduzzjoni bl-Ingliż fejn xieraq) |  |
| Sit web tal-entità elenkata fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR      |  |
| Isem il-kuntatt tal-firmatarju awtorizzat                   |  |
| Iindirizz postali tal-firmatarju awtorizzat                 |  |
| Iindirizz tal-email tal-firmatarju awtorizzat               |  |

6.4.2.2 Dettalji ta' kuntratt għall-utent tad-*data* tat-TR (jew tim) fl-entità elenkata skont l-Artikolu 81(3) tal-EMIR biex jirċievi notifiki importanti

**TABELLA 99**

|                                                                                                       |  |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| Isem il-kuntatt                                                                                       |  |
| Indirizz tal-email                                                                                    |  |
| Numru tat-telefon                                                                                     |  |
| Kredenzjali għal konnessjoni SSH FTP sigura                                                           |  |
| Kodiċi TRACE tal-awtorità                                                                             |  |
| Ċavetta tal-awtorità                                                                                  |  |
| Kwalunkwe informazzjoni teknika oħra rilevanti għall-aċċess tal-entità għad-dettalji tad-derivattivi. |  |

#### 6.4.2.3 Il-mandati tal-EMIR applikabbli għal entità partikolari elenkata fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR

**TABELLA 100**

|                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                              |
|--------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|
| (UE) 648/2012, l-Artikolu 81(3)            | Kummenti (jekk jogħġbok indika kull mandat li fil-fehma tiegħek jippermettilek taċċessa d- <i>data</i> u r-relazzjoni bejn tali mandat u d- <i>data</i> mitluba. Fit-taqsimha tal-kummenti jekk jogħġbok identifika l-istrument legali jew il-leġiżlazzjoni abilitanti fil-ġurisdizzjoni tiegħek li tistabbilixxi l-mandat rilevanti). |                              |
| Entità elenkata fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR | <b>Kummenti</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <b>Jekk jogħġbok immarka</b> |

|             |  |                          |
|-------------|--|--------------------------|
| (A) ESMA    |  | <input type="checkbox"/> |
| (B) EBA     |  | <input type="checkbox"/> |
| (C) EIOPA   |  | <input type="checkbox"/> |
| (D) II-BERS |  | <input type="checkbox"/> |

| Entità elenkata fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR                                                                                                                                                                                                                                | Kummenti | Jekk jogħġ bokk immarka  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|--------------------------|
| (E) L-awtorità kompetenti li tissorvelja s-CCPs li jkollhom aċċess għar-repożitorji tat-tranżazzjonijiet                                                                                                                                                                  |          | <input type="checkbox"/> |
| (F) L-awtorità kompetenti li tissorvelja ċ-ċentri tan-negozjar fejn ġew konklużi d-derivattivi rapportati                                                                                                                                                                 |          | <input type="checkbox"/> |
| (G1) Membru tas-SEBĊ, li l-munita tiegħu hija l-ewro                                                                                                                                                                                                                      |          | <input type="checkbox"/> |
| (G2) Membru tas-SEBĊ, li l-munita tiegħu mhijiex l-ewro                                                                                                                                                                                                                   |          | <input type="checkbox"/> |
| (G3) Il-BĊE                                                                                                                                                                                                                                                               |          | <input type="checkbox"/> |
| (H) L-awtoritajiet rilevanti ta' pajjiż terz li jkunu daħlu fi ftehim internazzjonali mal-Unjoni kif imsemmi fl-Artikolu 75                                                                                                                                               |          | <input type="checkbox"/> |
| (I) L-awtoritajiet superviżorji maħtura skont l-Artikolu 4 tad-Direttiva 2004/25/KE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill.                                                                                                                                                  |          | <input type="checkbox"/> |
| (J) L-awtoritajiet rilevanti tat-titoli u s-swieq tal-Unjoni li r-responsabbiltajiet u l-mandati superviżorji rispettivi tagħhom jkopru l-kuntratti, is-swieq, il-klassifikazzjonijiet, il-partecipanti u s-sottostanti li jaqgħu taħt il-kamp ta' applikazzjoni tal-EMIR |          | <input type="checkbox"/> |
| (K) L-awtoritajiet rilevanti ta' pajjiż terz li jkunu daħlu f'arranġament ta' kooperazzjoni mal-ESMA, kif imsemmi fl-Artikolu 76                                                                                                                                          |          | <input type="checkbox"/> |
| (L) L-Awtorità għall-Kooperazzjoni tar-Regolaturi tal-Enerġija stabbilita bir-Regolament (KE) Nru 713/2009 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill                                                                                                                            |          | <input type="checkbox"/> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                       |  |                          |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------------------------|
| (M) L-awtoritajiet ta' riżoluzzjoni maħtura skont l-Artikolu 3 tad-Direttiva 2014/59/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill                                                                                                                                                           |  | <input type="checkbox"/> |
| (N) Il-Bord Uniku ta' Riżoluzzjoni stabbilit bir-Regolament (UE) Nru 806/2014                                                                                                                                                                                                         |  | <input type="checkbox"/> |
| (O) L-awtoritajiet kompetenti jew l-awtoritajiet nazzjonali kompetenti fis-sens tar-Regolamenti (UE) Nru 1024/2013 u (UE) Nru 909/2014 u tad-Direttivi 2003/41/KE, 2009/65/KE, 2011/61/UE, 2013/36/UE, u 2014/65/UE, u l-awtoritajiet superviżorji fis-sens tad-Direttiva 2009/138/KE |  | <input type="checkbox"/> |
| (P) L-awtoritajiet kompetenti maħtura f'konformità mal-Artikolu 10(5) ta' dan ir-Regolament.                                                                                                                                                                                          |  | <input type="checkbox"/> |
| (Q) L-awtoritajiet rilevanti ta' pajjiż terz li fir-rigward tagħhom ikun ġie adottat att ta' implimentazzjoni skont l-Artikolu 76a.                                                                                                                                                   |  | <input type="checkbox"/> |
| (R) L-awtoritajiet ta' riżoluzzjoni maħtura skont l-Artikolu 3 tar-Regolament (UE) 2021/23                                                                                                                                                                                            |  | <input type="checkbox"/> |

#### 6.4.2.4 Kampijiet tad-*data* rilevanti għall-iffiltrar

**TABELLA 101**

|                                                                                                                                                   |  |                          |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------------------------|
| L-applikant huwa kompetenti għall-kontropartijiet fl-Istat Membru tiegħu, iż-żona ewro jew l-Unjoni                                               |  | <input type="checkbox"/> |
| It-tipi ta' kontropartijiet li għalihom l-entità hija kompetenti skont il-klassifikazzjoni fit-Tabella 1 tal-Anness I għall-RTS dwar ir-rapportar |  | <input type="checkbox"/> |
| It-tipi ta' sottostanti għad-derivattivi li l-awtorità hija kompetenti għalihom                                                                   |  | <input type="checkbox"/> |
| lċ-ċentri ta' negozjar li jkunu taħt superviżjoni mill-entità, jekk ikun hemm                                                                     |  | <input type="checkbox"/> |
| is-CCPs li huma taħt superviżjoni jew issorveljati mill-entità, jekk ikun hemm                                                                    |  | <input type="checkbox"/> |

|                                                                                                  |  |                          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--------------------------|
| Il-munita li tinħareġ mill-entità, jekk ikun hemm                                                |  | <input type="checkbox"/> |
| Il-punti tal-konsenja u tal-interkonnessjoni;                                                    |  | <input type="checkbox"/> |
| Il-klassifikazzjonijiet użati fl-Unjoni, li l-entità hija kompetenti għall-amministratur tagħhom |  | <input type="checkbox"/> |
| Karatteristiċi tas-sottostanti li huma sorveljati minn dik l-entità                              |  | <input type="checkbox"/> |
| Membri tal-ikklerjar, sensara u entità referenzjarja rilevanti                                   |  | <input type="checkbox"/> |

Firmatarju awtorizzat:

Isem:

---

Titolu:

---

Firma:

---

Data (jj/xx/ssss):

---

#### 6.4.3 Kampijiet tal-EMIR għall-iffiltrar tad-*data*

687. Skont l-Artikolu 81(3) tal-EMIR, repożitorju tad-*data* dwar it-tranzazzjonijiet għandu jagħmel l-informazzjoni meħtieġa disponibbli għall-entitajiet li ġejjin sabiex dawn ikunu jistgħu jwettqu r-responsabbiltajiet u l-mandati rispettivi tagħhom. F'dan ir-rigward, it-TRS għandhom jużaw il-kjarifiki fit-tabella li ġejja. Il-kampijiet indikati huma bbażati fuq is-setgħat u l-mandati eżistenti fil-ħin tal-abbozzar ta' dawn il-Linji Gwida, u għalhekk it-TRS m'għandhomx ikunu marbuta bil-kjarifiki inklużi f'dawn il-Linji Gwida, iżda jimmonitorjaw b'mod proattiv l-evoluzzjonijiet tar-responsabbiltajiet u tal-mandati rilevanti u jaġġustaw l-aċċess għall-awtoritajiet kif

xieraq. Qabel ma jiġi implimentat aġġustament, it-TRs għandhom jikkonfermawh mal-ESMA u mal-awtorità rilevanti.

**TABELLA 102**

| Lista ta' entitajiet fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR                                                                                                                      | Kampijiet għall-filtrazzjoni                          | Valuri għall-filtrazzjoni                                                                                                                             |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| a) ESMA                                                                                                                                                              | Mhux applikabbli                                      | Mhux applikabbli                                                                                                                                      |
| b) EBA                                                                                                                                                               | Mhux applikabbli                                      | Mhux applikabbli                                                                                                                                      |
| c) EIOPA                                                                                                                                                             | Mhux applikabbli                                      | Mhux applikabbli                                                                                                                                      |
| d) Il-BERS                                                                                                                                                           | Mhux applikabbli                                      | Mhux applikabbli                                                                                                                                      |
| e) L-awtorità kompetenti li tissorvelja s-CCPs li jkollhom aċċess għar-repożitorji tat-tranzazzjonijiet                                                              | Kamp 2.33 "Kontroparti ċentrali"                      | Lista ta' LEIs ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                               |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.4 "Kontroparti (Kontroparti li tirrapporta)" 1 | Lista ta' LEIs ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                               |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.9 "Kontroparti 2"                              | Lista ta' LEIs ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                               |
| f) L-awtorità kompetenti li tissorvelja ċ-ċentri tan-negozjar tal-kuntratti rrapportati                                                                              | Kamp 2.41 "Ċentru tal-eżekuzzjoni"                    | Lista ISO għall-kodicijiet MIC, kodici tal-pajjiż ipprovdut mill-Awtorità                                                                             |
| g) Il-membri rilevanti tas-SEBC, inkluż il-BCE fit-tweġġ tal-kompiti tagħha fi hdan mekkaniżmu superviżorju uniku skont ir-Regolament tal-Kunsill (UE) Nru 1024/2013 | Kamp 2.144 "Entità referenzjarja"                     | Il-bażi tad-data GLEIF iffiltrata miż-żona ewro u lista tal-entitajiet fi Stat Membru mhux fiż-żona ewro soġġetti għall-ECB SSM, kif applikabbli      |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 2.14 "Identifikazzjoni tas-sottostanti"          | Prefiss għall-Istat Membru, UE, EZ, XS, XA, XB, XC, XD                                                                                                |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.4 "Kontroparti (Kontroparti li tirrapporta)" 1 | Il-bażi tad-data GLEIF iffiltrata skont iż-żona ewro u lista tal-entitajiet fi Stat Membru mhux fiż-żona ewro soġġetti għall-ECB SSM, kif applikabbli |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.9 "Kontroparti 2"                              | Il-bażi tad-data GLEIF iffiltrata skont iż-żona ewro u lista tal-entitajiet fi Stat Membru mhux fiż-żona ewro soġġetti għall-ECB SSM, kif applikabbli |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.15 "ID tas-sensar"                             | Il-bażi tad-data GLEIF iffiltrata miż-żona ewro u lista tal-entitajiet fi Stat Membru mhux fiż-żona ewro soġġetti għall-ECB SSM, kif applikabbli      |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.16 "Membru tal-ikklerjar"                      | Il-bażi tad-data GLEIF iffiltrata skont iż-żona ewro u lista tal-entitajiet fi Stat Membru mhux fiż-żona ewro soġġetti għall-ECB SSM, kif applikabbli |
| h) L-awtoritajiet rilevanti ta' pajjiż terz li jkunu daħlu fi ftehim internazzjonali mal-Unjoni kif imsemmi fl-Artikolu 75                                           | Mhux applikabbli                                      | Mhux applikabbli                                                                                                                                      |
| i) L-awtoritajiet superviżorji maħtura skont l-Artikolu 4 tad-Direttiva 2004/25/KE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill                                               | Kamp 2.14 "Identifikazzjoni tas-sottostanti"          | Prefiss għall-Istat Membru, UE, EZ, XS, XA, XB, XC, XD, u<br>Lista ta' ISINs ipprovduta mill-Awtorità                                                 |
| j) L-awtoritajiet rilevanti tat-titoli u s-swieq tal-Unjoni rilevanti li r-                                                                                          | Kamp 1.4 "Kontroparti (Kontroparti li tirrapporta)" 1 | Bażi tad-data GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru fiż-żona ewro u mhux fiż-żona ewro, kif applikabbli                                                  |
|                                                                                                                                                                      | Kamp 1.9 "Kontroparti 2"                              | Bażi tad-data GLEIF iffiltrata skont l-Istat Membru fiż-żona ewro u mhux fiż-żona ewro, kif applikabbli                                               |

|                                                                                                                                                                                                         |                                                              |                                                                                                                                                                                                                  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| responsabbiltajiet u l-mandati superviżorji rispettivi tagħhom ikopru l-kuntratti, is-swieq, il-klassifikazzjonijiet, il-partecipanti u s-sottostanti li jaqgħu taħt il-kamp ta' applikazzjoni tal-EMIR | Kamp 1.15 "ID tas-sensar"                                    | Baži tad-data GLEIF iffiltrata skont l-Istat Membru fiż-żona ewro u mhux fiż-żona ewro, kif applikabbli                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 1.16 "Membru tal-ikklerjar"                             | Baži tad-data GLEIF iffiltrata skont l-Istat Membru fiż-żona ewro u mhux fiż-żona ewro, kif applikabbli                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.14 "Identifikazzjoni tas-sottostanti"                 | L-awtorità kompetenti rilevanti (RCA) mill-baži tad-data FIRDS, prefiss għall-Istat Membru, UE, EZ, XS, XA, XB, XC, XD                                                                                           |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.7 "ISIN"                                              | L-awtorità kompetenti rilevanti (RCA) mill-baži tad-data FIRDS, prefiss għall-Istat Membru, UE, EZ, XS, XA, XB, XC, XD                                                                                           |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.41 "Ċentru tal-eżekuzzjoni"                           | Lista ISO għall-kodiċijiet MIC, kodiċi tal-pajjiż ipprovdut mill-Awtorità                                                                                                                                        |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.8 "UPI"                                               | Lista ta' UPIs ipprovduta mill-Awtorità <sup>26</sup>                                                                                                                                                            |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.15 "Indikatur tal-indiċi sottostanti"                 | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.16 "Isem l-indiċi sottostanti"                        | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.83 "Identifikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 1" | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.84 "Indikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 1"     | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.85 "Isem ir-rata varjabbli tal-komponent 1"           | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.99 "Identifikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2" | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.100 "Indikatur tar-rata varjabbli tal-komponent 2"    | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
|                                                                                                                                                                                                         | Kamp 2.101 "Isem tar-rata varjabbli tal-komponent 2"         | Lista ta' klassifikazzjonijiet ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                          |
| k) l-awtoritajiet rilevanti ta' pajjiż terz li daħlu f'arranġament ta' kooperazzjoni mal-ESMA, kif imsemmi fl-Artikolu 76;                                                                              | Mhux applikabbli                                             | Mhux applikabbli                                                                                                                                                                                                 |
| l) l-Aġenzija għall-Kooperazzjoni tar-Regolaturi tal-Energija stabbilita bir-Regolament (KE) Nru 713/2009 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill;                                                          | Kamp 2.116 "Prodott baži"<br>Kamp 2.117 "Prodott sekondarju" | [(kamp 2.16 "Prodott baži" = "NRGY" u (kamp 2.17 "Prodott sekondarju" = "ELEC" jew kamp 2.17 "Prodott sekondarju" = "NGAS")) jew [(kamp 2.16 "Prodott baži" = "ENVR" u kamp 2.17 "Prodott sekondarju" = "EMIS")] |

<sup>26</sup> Access għad-data bbażat fuq il-UPI flimkien ma' kwalunkwe mandat ieħor

|                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| m) l-awtoritajiet ta' riżoluzzjoni maħtura skont l-Artikolu 3 tad-Direttiva 2014/59/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill;                                                                                                                                                   | Kamp 1.4 "Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)"<br>Kamp 1.6 "Settur korporattiv tal-kontroparti 1" | Il-baži tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru, fejn il-kamp 1.6 "Settur korporattiv tal-kontroparti 1" huwa "INVF" Ditta tal-investment awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2014/65/UE jew "CDTI" Istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva (UE) 2013/36/UE<br>Il-baži tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru, fejn il-kamp 1.12 "Settur korporattiv tal-kontroparti 2" huwa "INVF" Ditta tal-investment awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2014/65/UE jew "CDTI" Istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva (UE) 2013/36/UE                                                                                                                                                                                                                                                     |
|                                                                                                                                                                                                                                                                               | Kamp 1.15 "ID tas-sensar"                                                                                | Lista ta' LEIs ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|                                                                                                                                                                                                                                                                               | Kamp 1.16 "Membru tal-ikklerjar"                                                                         | Lista ta' LEIs ipprovduta mill-Awtorità                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|                                                                                                                                                                                                                                                                               | Kamp 1.4 "Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)"<br>Kamp 1.9 "Kontroparti 2"                        | Lista ta' LEIs soġġetti għall-SRB, ipprovduta mill-SRB<br>Lista ta' LEIs soġġetti għall-SRB, ipprovduta mill-SRB                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| n) il-Bord Uniku ta' Riżoluzzjoni stabbilit mir-Regolament (UE) Nru 806/2014;                                                                                                                                                                                                 | Kamp 1.15 "ID tas-sensar"                                                                                | Lista ta' LEIs soġġetti għall-SRB, ipprovduta mill-SRB                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|                                                                                                                                                                                                                                                                               | Kamp 1.16 "Membru tal-ikklerjar"                                                                         | Lista ta' LEIs soġġetti għall-SRB, ipprovduta mill-SRB                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| o) awtoritajiet kompetenti u awtoritajiet nazzjonali kompetenti fis-sens tar-Regolamenti (UE) Nru 1024/2013 u (UE) Nru 909/2014 u tad-Direttivi 2003/41/KE, 2009/65/KE, 2011/61/UE, 2013/36/UE, u 2014/65/UE, u awtoritajiet superviżorji fis-sens tad-Direttiva 2009/138/KE; | Kamp 1.4 "Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)"<br>Kamp 1.6 "Settur korporattiv tal-kontroparti 1" | Il-baži tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru fejn il-kamp 1.6 "Settur korporattiv tal-kontroparti 1" ikun: "CDTI" istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva (UE) 2013/36/UE; jew "CSDS" depożitorju ċentrali tat-titoli awtorizzat f'konformità mar-Regolament (UE) Nru 909/2014; jew "INVF" istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2014/65/UE; jew "INUN" impriża tal-assigurazzjoni jew tar-riassigurazzjoni awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2009/138/UE; jew "AIFD" fond ta' investment alternattiv kif definit fid-Direttiva 2011/61/UE; jew "UCIT" UCITS u, fejn rilevanti il-kumpanija maniġerjali tiegħu awtorizzat f'konformità mad-Direttiva 2009/65/KE; "ORPI" istituzzjoni għall-provvista ta' rtirar okkupazzjonali (IORP) kif definita f'konformità mad-Direttiva 2016/2341 |
|                                                                                                                                                                                                                                                                               | Kamp 1.9 "Kontroparti 2"<br>Kamp 1.12 "Settur korporattiv tal-kontroparti 2"                             | Il-baži tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru fejn il-kamp 1.12 "Settur korporattiv tal-kontroparti 2" ikun: "CDTI" istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva (UE) 2013/36/UE; jew "CSDS" depożitorju ċentrali tat-titoli awtorizzat skont ir-Regolament (UE) Nru 909/2014; jew "INVF" istituzzjoni ta' kreditu awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2014/65/UE; jew "INUN" impriża tal-assigurazzjoni jew tar-riassigurazzjoni awtorizzata f'konformità mad-Direttiva 2009/138/UE; jew "AIFD" fond ta' investment alternattiv kif definit fid-Direttiva 2011/61/UE; jew                                                                                                                                                                                                                                                |

|                                                                                                                                  |                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                     |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                  |                                                                                              | “UCIT” UCITS u, fejn rilevanti l-kumpanija manigjerjali tiegħu awtorizzata f’konformità mad-Direttiva 2009/65/KE;<br>“ORPI” istituzzjoni għall-provvista ta’ rtirar okkupazzjonali (IORP) kif definita skont id-Direttiva 2016/2341 |
|                                                                                                                                  | Kamp 2.10 “Pajjiż tal-kontroparti 2”                                                         | Iffiltrat mill-Istat Membru                                                                                                                                                                                                         |
| p) l-awtoritajiet kompetenti maħtura f’konformità mal-Artikolu 10(5) tal-EMIR                                                    | Kamp 1.4 “Kontroparti 1 (Kontroparti li tirrapporta)”<br>Kamp 1.5 “Natura tal-kontroparti 1” | Il-bażi tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru u “Natura tal-kontroparti 1” = “N”<br>Fejn “N” tirreferi għal kontroparti mhux finanzjarja                                                                              |
|                                                                                                                                  | Kamp 1.9 “Kontroparti 2”<br>Kamp 1.11 “Natura tal-kontroparti 2”                             | Il-bażi tad- <i>data</i> GLEIF iffiltrata mill-Istat Membru u “Natura tal-kontroparti 2” = “N”<br>Fejn “N” tirreferi għal kontroparti mhux finanzjarja                                                                              |
| q) l-awtoritajiet rilevanti ta’ pajjiż terz li fir-rigward tiegħu jkun għe adottat att ta’ implimentazzjoni skont l-Artikolu 76a | Mhux applikabbli                                                                             | Mhux applikabbli                                                                                                                                                                                                                    |