



European Securities and  
Markets Authority

# Linji Gwida

**Rapportar skont l-Artikoli 4 u 12 SFTR**



## Werrej

1	Referenzi legiżlattivi, taqsiriet u definizzjonijiet .....	5
2	Kamp ta' applikazzjoni.....	6
3	Għan .....	7
4	Prinċipji Ġenerali .....	7
4.1	<i>Data</i> tal-bidu tar-rapportar .....	7
4.2	Determinazzjoni tan-numru ta' SFTs li jistgħu jiġu rrapportati .....	8
4.2.1	Tranzazzjonijiet tas-suq li ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta' SFT .....	8
4.2.2	Aspetti relatati mat-tipi kollha ta' SFTs.....	8
4.2.3	Aspetti relatati mar-repos.....	10
4.2.4	Aspetti relatati mal-BSB/SBB.....	10
4.2.5	Aspetti relatati ma' għoti u teħid b'self ta' titoli.....	11
4.2.6	Aspetti relatati ma' SFTs li jinvolvu komoditajiet.....	11
4.2.7	Aspetti relatati ma' self b'marġni .....	13
4.3	Rapportar ta' SFTs ikklirjati minn CCP .....	14
4.4	Allokazzjoni tar-responsabbiltà skont l-Artikolu 4(3) SFTR .....	15
4.4.1	Każ ġenerali .....	15
4.4.2	Pajjiż terz - Kontropartijiet Finanzjarji (TC-FC).....	15
4.4.3	Fondi .....	15
4.5	Delega volontarja tar-rapportar.....	15
4.6	Applikazzjoni tal-obbligi ta' rapportar tal-SFTR għal SFTs konkluzi minn fergħat..	15
4.6.1	Applikazzjoni tal-obbligi ta' rapportar tal-SFTR għal SFTs konkluzi minn entitajiet mhux fl-UE b'fergħat fl-UE .....	15
4.6.2	Determinazzjoni tal-SFTs rapportabbli meta jiġu konkluzi minn fergħat .....	16
4.7	Rapportar minn NFC .....	17
4.8	Tipi ta' azzjoni .....	17
4.8.1	Tipi ta' azzjoni applikabbli .....	17
4.8.2	Rapportar b'ħarsa sħiħa kontra rapportar parzjali tal-emendi għal SFTs.....	18
4.8.3	Sekwenza bejn it-tipi ta' azzjoni għat-tipi differenti ta' messagġi .....	18
4.9	Rapportar f'waqtu ta' konkluzjoni, ta' modifika u ta' terminazzjoni ta' SFT .....	22
4.9.1	Konkluzjoni ta' SFT.....	22
4.9.2	Modifika u korrezzjoni ta' SFT.....	23
4.9.3	Aġġornamenti tal-kollateral .....	23

4.9.4	Agġornamenti tal-valwazzjoni, tal-marġni u tal-użu mill-ġdid .....	24
4.9.5	Terminazzjoni ta' SFT .....	25
4.9.6	Ħarsa ġenerali lejn l-iskedi ta' żmien tar-rapportar għal kull tip ta' rapport u tip ta' azzjoni .....	25
4.10	Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjonijiet.....	26
4.11	Identifikazzjoni ta' parteċipant tas-CSD .....	33
4.12	Determinazzjoni tan-naħa tal-kontroparti .....	33
4.12.1	Każ ġenerali .....	33
4.12.2	SFTs ikklirjati minn CCP .....	34
4.12.3	Rapportar ta' għoti/teħid b'self mhux garantit ta' titoli .....	34
4.12.4	Ir-rapportar tan-naħa tal-kontroparti fil-każ ta' kollateralizzazzjoni tal-iskopertura netta .....	34
4.13	Kampijiet tal-prezz u tal-valur .....	34
4.13.1	Twaqqit tal-valwazzjonijiet .....	34
4.13.2	Metodu ta' kalkolu għall-valutazzjonijiet .....	34
4.14	Rapportar tas-CFI għal titolu użat bħala kollateral .....	35
4.15	Posponiment lejn tmiem il-perjodu.....	35
4.16	Ġenerazzjoni u struttura tal-UTI .....	36
4.17	Identifikazzjoni u rapportar dwar il-benefiċjarji .....	38
4.18	Identifikazzjoni tal-emittent tat-titoli u t-titoli .....	38
4.19	Proċedura meta kontroparti tgħaddi minn azzjoni korporattiva .....	39
4.20	Rapportar fil-perjodu ta' introduzzjoni gradwali .....	40
5	Tabelli tal-kampijiet tal-SFTR .....	40
5.1	<i>Data</i> dwar il-kontroparti .....	42
	Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITs management company delegates reporting to a third party .....	44
	Non-cleared SFTs concluded by AIF .....	44
	Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced.....	44
5.1.1	SFTs bilaterali mhux ikklirjati bejn il-kwartieri ġenerali .....	44
5.1.2	SFT bilaterali mhux ikklirjata bejn fergħat .....	46
5.1.3	SFT bilaterali mhux ikklirjata ma' benefiċjarji.....	48
5.1.4	SFT mhux ikklirjata ma' sensara finanzjarji, saldata b'bank kustodju .....	49
5.1.5	SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku.....	51

5.1.6	SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku, saldata ma' parteċipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza.....	53
5.1.7	SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku .	55
5.1.8	SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku, saldata ma' parteċipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza .....	57
5.1.9	SFTs mhux ikklirjati konklużi minn fond tal-UCITS.....	59
5.1.10	SFTs mhux ikklirjati konklużi minn fond tal-UCITS, u l-kumpanija ta' ġestjoni tal-UCITS tiddelega r-rapportar lil parti terza.....	61
5.1.11	SFTs mhux ikklirjati konklużi minn AIF .....	62
5.1.12	SFTs mhux ikklirjati fejn il-ġestjoni tal-portafolli tal-fondi tiġi esternalizzata .....	64
5.2	<i>Data</i> dwar is-Self u l-Kollateral .....	66
5.2.1	Ir-rapportar tat-tipi ta' azzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet u fil-livell tal-pożizzjonijiet. ....	66
5.3	<i>Data</i> dwar is-Self.....	77
5.3.1	Rapportar tad- <i>data</i> dwar l-avveniment.....	77
5.3.2	Rapportar ta' SFT ikklirjata/mhux ikklirjata .....	78
5.3.3	Ċentru tan-negozjar .....	84
5.3.4	Taqsimha tal-ftehim prinċipali .....	84
5.3.5	Konkluzjoni u bidu tat-tranzazzjoni.....	87
5.3.6	Terminu tal-SFT.....	88
5.3.7	Għazla -tat-terminazzjoni.....	90
5.3.8	Arranġamenti ġenerali u speċifiċi tal-kollateral .....	91
5.3.9	Rati fissi jew varjabbli .....	93
5.3.10	Ammonti prinċipali ta' repo u ta' BSB/SBB.....	97
5.3.11	Naħa tas-self f'self ta' titoli .....	97
5.3.12	Titoli.....	98
5.3.13	SFTs li jinvolve komoditajiet – self ta' komoditajiet.....	103
5.3.14	SLB ta' ribass ta' flus .....	105
5.3.15	SLB ibbażati fuq tariffi: SLB ta' kollateral mhux fi flus, SLB ta' pula ta' flus u SLB mhux kollateralizzati .....	106
5.3.16	Ammont ta' self b'marġni u valur qasir tas-suq.....	107
5.4	<i>Data</i> dwar il-kollateral.....	110
5.4.1	Ir-rapportar ta' kollateralizzazzjoni ta' SLB.....	110
5.4.2	Kollateralizzazzjoni .....	111
5.4.3	Kollataral fi flus .....	118

5.4.4	Rapportar ta' kollateral żero.....	119
5.4.5	Kampijiet tal-kollateral ta' garanzija.....	119
5.4.6	Proviżjonament ta' marġni ta' varjazzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet għal SFTs ikklirjati mhux ċentralment.....	130
5.4.7	Proviżjonament ta' marġni ta' varjazzjoni għal SFTs ikklirjati mhux ċentralment fil-każ ta' kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoni netta .....	139
5.4.8	Kollateral imħallas minn qabel għal SLB .....	180
5.4.9	Il-portafoll ta' tranzazzjonijiet ikklirjati .....	181
5.5	<i>Data</i> dwar il-marġni .....	182
5.5.1	Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li jkunu membri tal-ikklirjar .....	182
5.5.2	Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li ma jkunux membri tal-ikklirjar .....	183
5.5.3	Rapportar ta' informazzjoni dwar il-marġni.....	183
5.6	I-użu mill-ġdid ta' data, ri-investment ta' flus kontanti u sorsi ta' finanzjament ....	184
5.6.1	Użu mill-ġdid tal-kollateral.....	185
5.6.2	Ri-investment tal-kollateral fi flus kontanti .....	192
5.6.3	Użu mill-ġdid ta' kollateral żero mhux fi flus u ri-investment ta' flus .....	198
5.6.4	Sorsi ta' finanzjament .....	199
6	Feedback dwar ir-rifjut.....	200
7	Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni.....	202
8	Feedback dwar kollateral nieqes .....	205
9	Kif tiġi pprovduta informazzjoni lill-awtoritajiet.....	206
9.1	Skedi ta' żmien biex jiġi stabbilit l-aċċess għad- <i>data</i> .....	206
9.2	Arranġamenti operazzjonali għall-aċċess għad- <i>data</i> .....	206

# 1 Referenzi legiżlattivi, taqsiriet u definizzjonijiet

## Referenzi legiżlattivi

<i>AIFMD</i>	Id-Direttiva 2011/61/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tat-8 ta' Ġunju 2011 dwar Maniġers ta' Fondi ta' Investiment Alternattivi (AIFMs)
<i>Direttiva dwar il-Kollateral</i>	Id-Direttiva 2002/47/KE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-6 ta' Ġunju 2002 dwar arranġamenti finanzjarji kollaterali
<i>Direttiva dwar il-Kreditu għall-Konsumatur</i>	Id-Direttiva 2008/48/KE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tat-23 ta' April 2008 dwar ftehim ta' kreditu għall-konsumatur u li tħassar id-Direttiva tal-Kunsill 87/102/KEE
<i>ITS dwar ir-rapportar</i>	Ir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2019/363 tat-13 ta' Diċembru 2018 li jistipula standards tekniċi ta' implimentazzjoni rigward il-format u l-frekwenza tar-rapporti dwar id-dettalji ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli lir-repożitorji tat-tranżazzjonijiet skont ir-Regolament (UE) 2015/2365 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill u li jemenda Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 1247/2012 rigward l-użu ta' kodiċi ta' rapportar fir-rapportar tal-kuntratti tad-derivati
<i>EMIR</i>	Ir-Regolament dwar l-Infrastruttura tas-Suq Ewropew – Ir-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad- <i>data</i> dwar it-tranżazzjonijiet
<i>MAR</i>	Ir-Regolament (UE) Nru 596/2014 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tas-16 ta' April 2014 dwar l-abbuż tas-suq (Regolament dwar l-abbuż tas-suq).
<i>MiFIR</i>	Ir-Regolament (UE) Nru 600/2014 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar is-swieq tal-istrumenti finanzjarji u li jemenda r-Regolament (UE) Nru 648/2012
<i>MMSR</i>	Ir-Regolament (UE) Nru 1333/2014 dwar l-istatistika tas-swieq monetarji
<i>Id-Direttiva dwar il-Kreditu Ipotekarju</i>	Id-Direttiva 2014/17/UE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-4 ta' Frar 2014 dwar kuntratti ta' kreditu għall-konsumaturi marbutin ma' proprjetà immobbli residenzjali u li temenda d-Direttivi 2008/48/KE u 2013/36/UE u r-Regolament (UE) Nru 1093/2010



REMIT

Ir-Regolament (UE) Nru 1227/2011 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-25 ta' Ottubru 2011 dwar l-integrità u t-trasparenza tas-swieq tal-enerġija bl-ingrossa

*RTS dwar ir-rapportar*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) Nru 2019/356 tat-13 ta' Diċembru 2018 li jissupplimenta r-Regolament (UE) 2015/2365 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji li jispeċifikaw id-dettalji ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli (SFTs) li għandhom jiġu rrapportati lir-repożitorji tat-tranżazzjonijiet

*RTS dwar l-aċċess għad-data*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2019/357 tat-13 ta' Diċembru 2018 li jissupplimenta r-Regolament (UE) 2015/2365 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward tal-istandards tekniċi regolatorji dwar l-aċċess għal dettalji ta' tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli (SFT) miżmuma f'repożitorji tat-tranżazzjonijiet

*RTS dwar il-verifika tad-data*

Ir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2019/358 tat-13 ta' Diċembru 2018 li jissupplimenta r-Regolament (UE) 2015/2365 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill fir-rigward ta' standards tekniċi regolatorji dwar il-ġbir, il-verifika, l-aggregazzjoni, il-paragun u l-pubblikazzjoni ta' *data* dwar tranżazzjonijiet ta' finanzjament tat-titoli (SFT) minn repożitorji tat-tranżazzjonijiet

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 – imsejjaħ ukoll bħala r-regolament

TS

RTS dwar ir-rapportar (Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2019/356) u ITS dwar ir-rapportar (Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2019/363)

UCITS

Id-Direttiva 2009/65/KE tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tat-13 ta' Lulju 2009 dwar il-koordinazzjoni ta' liġijiet, regolamenti u dispożizzjonijiet amministrattivi fir-rigward tal-impriżi ta' investiment kollettiv f'titoli trasferibbli (UCITS)

## 2 Kamp ta' applikazzjoni

Min?

1. Dawn il-linji gwida japplikaw għall-kontropartijiet għall-SFTs kif definiti fl-Artikolu 3(2) SFTR, għar-repożitorji tat-tranżazzjonijiet kif definiti fl-Artikolu 3(1) SFTR u għall-awtoritajiet kompetenti.



## Xiex?

2. Dawn il-linji gwida japplikaw fir-rigward tal-obbligu ta' rapportar tal-SFTs kif previst fl-Artikolu 4 SFTR, tal-obbligi tat-TR skont l-Artikoli 5(7) u 12 SFTR, kif ukoll tad-data tal-bidu tar-rapportar kif iddeterminata fl-Artikolu 33(2) SFTR.

## Meta?

3. Dawn il-linji gwida japplikaw mill-jum wara dak tal-pubblikazzjoni tagħhom fuq is-sit web tal-ESMA jew mid-data li fiha japplikaw id-dispożizzjonijiet rilevanti għall-entitajiet kif stabbilit mill-Artikolu 33(2) SFTR, skont liema data tiġi l-aħħar.
4. Il-kontropartijiet, l-entitajiet responsabbli għar-rapportar u l-entitajiet li jissottomettu r-rapporti huma mhegġa jużawhom sa mill-ewwel jum li fih isir applikabbli l-obbligu ta' rapportar rilevanti skont l-Artikolu 33(2)(a) SFTR.

## 3 Għan

5. Dawn il-linji gwida huma bbażati fuq l-Artikolu 16(1) tar-Regolament tal-ESMA. Dawn il-linji gwida għandhom l-għan li jiċċaraw numru ta' dispożizzjonijiet tal-SFTR u li jipprovdu gwida Prattika dwar l-implimentazzjoni ta' xi wħud minn dawk id-dispożizzjonijiet. Il-Linji Gwida se jikkontribwixxu għat-tnaqqis tal-ispejjeż tul il-katina sħiħa ta' rapportar - il-kontropartijiet li jirrapportaw id-*data*, it-TRs li jimplimentaw il-proċeduri biex jivverifikaw il-kompletezza u l-korrettezza tad-*data*, u l-awtoritajiet, iddefiniti fl-Artikolu 12(2) SFTR, li jużaw id-*data* biex jissorveljaw ir-riskji għall-istabbiltà finanzjarja. Il-linji gwida jipprovdu ċarezza dwar l-aspetti li ġejjin:
  - a. id-*data* tal-bidu tar-rapportar meta din taħbat f'jum mhux tax-xogħol.
  - b. in-numru ta' SFTs li jistgħu jiġu rrapportati;
  - c. il-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar għal tipi differenti ta' SFTs;
  - d. l-approċċ użat biex kollateral tal-SFTs jiġi assoċjat ma' self tal-SFTs;
  - e. il-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar għad-*data* dwar il-marġni;
  - f. il-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar għad-*data* dwar l-użu mill-ġdid, l-investment mill-ġdid u s-sorsi ta' finanzjament;
  - g. il-ġenerazzjoni ta' feedback mit-TRs u l-ġestjoni sussegwenti tagħha mill-kontropartijiet, jiġifieri fil-każ ta' (i) rifjut ta' *data* rrapportata u (ii) waqfiet ta' rikonċiljazzjoni; u
  - h. l-għoti ta' aċċess għad-*data* lill-awtoritajiet mit-TRs.

## 4 Prinċipji Ġenerali

### 4.1 *Data* tal-bidu tar-rapportar

6. L-obbligu ta' rapportar skont l-Artikolu 4(1) SFTR japplika skont id-*data* rilevanti tal-applikazzjoni speċifikata fl-Artikolu 33(2)(a) (i) SFTR. L-ewwel fażi tal-obbligu ssir



applikabbli fil-11 ta' April 2020, li jaħbat is-Sibt. Skont l-Artikolu 4(1) tal-SFTR, il-kontropartijiet jenħtieġ li jikkonformaw mal-obbligu ta' rapportar tagħhom sa mhux aktar tard mill-jum ta' xogħol ta' wara l-konklużjoni, il-modifika jew it-terminazzjoni tat-tranzazzjoni.

7. L-entitajiet imsemmija skont l-Artikolu 33(2)(a) (i) SFTR, stabbiliti fl-Istati Membri tal-UE meta t-13 ta' April ma jkunx festa pubblika, jiġifieri huwa jum ta' xogħol, jenħtieġ li jibdedw jirrapportaw mit-13 ta' April 2020 l-SFTs konklużi fil-11 ta' April 2020 jew wara.
8. L-entitajiet imsemmija skont l-Artikolu 33(2)(a) (i) SFTR, stabbiliti fl-Istati Membri tal-UE meta t-13 ta' April ikun festa pubblika, jiġifieri ma jkunx jum ta' xogħol, jenħtieġ li jibdedw jirrapportaw mill-14 ta' April 2020 l-SFTs konklużi fil-11 ta' April 2020 jew wara.
9. Jenħtieġ li jiġi segwit l-istess approċċ għall-bqija tad-dati ta' applikazzjoni tal-obbligu ta' rapportar.

## 4.2 Determinazzjoni tan-numru ta' SFTs li jistgħu jiġu rrapportati

10. Skont l-Artikolu 1(1) ITS dwar ir-rapportar, il-kontropartijiet jenħtieġ li jissottomettu r-rapporti tal-SFTs tagħhom f'forma komuni elettronika u li tinqara mill-magni u f'mudell XML komuni skont il-metodoloġija tal-ISO 20022. Biex dan jiġi ffaċilitat, dawn il-Linji Gwida jinkludu l-komponent XSD rilevanti applikabbli għall-każijiet ta' użu differenti.

### 4.2.1 Tranzazzjonijiet tas-suq li ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta' SFT

11. Jenħtieġ li t-tranzazzjonijiet li ġejjin ma jaqgħux taħt id-definizzjoni ta' SFT u jenħtieġ li ma jiġux irrapportati skont l-SFTR:
  - a. Self lil klijenti mhux professjonali regolat bil-leġiżlazzjoni dwar il-kreditu għall-konsumatur
  - b. Self bankarju privat u self Lombard mhux relatati ma' finanzjament ta' titoli
  - c. Self sindakat u self korporattiv ieħor għal skopijiet kummerċjali
  - d. Faċilitajiet ta' self kurrent ta' kustodji u faċilitajiet ta' self intraġurnata tas-CCP
  - e. Kreditu / self kurrenti fails-curing tal-istess ġurnata
  - f. Awtokollateralizzazzjoni ta' bank ċentrali
  - g. Give-ups u take-ups fil-katina tal-eżekuzzjoni u tal-ikklijerjar
  - h. Tranzazzjonijiet ta' komoditajiet li jkunu saru għal skopijiet operazzjonali u/jew industrijali
  - i. Tranzazzjonijiet li jinvolvu kwoti tal-emissjonijiet

### 4.2.2 Aspetti relatati mat-tipi kollha ta' SFTs

12. Parti għal SFT li taġixxi fuq bażi prinċipali, billi tagħmel tranzazzjonijiet f'isimha stess, jenħtieġ li tissejjaħ kontroparti ta' SFT.

13. Entità li tiffacilita, tirranġa jew tiegħu sehem b'mod ieħor, iżda mhux fuq bażi prinċipali u lanqas f'isimha stess, fil-konklużjoni ta' SFT, jew fuq is-self jew fuq in-naħa tal-kollateral, u taġixxi f'isem klijent, jenħtieġ li ma tkunx definita bħala kontroparti iżda bħala sensar finanzjarju, aġent sellief, aġent tripartitiku jew parteċipant ta' CSD, kif applikabbli. Entità waħda jista' jkollha diversi rwoli f'SFT. Il-popolazzjoni speċifika tad-*data* dwar il-kontroparti hija spjegata fit-Taqsima 5.1.
14. Għalhekk, huwa l-obbligu tal-kontropartijiet li jidentifikaw liema tip ta' SFT ikunu kkonkludew. B'mod simili, kif spjegat fid-dettall fl-Anness 1 tal-RTS dwar ir-rapportar u fit-Taqsima 5.2 ta' dan id-dokument, mhux il-kampijiet kollha huma applikabbli għall-SFTs kollha, u għalhekk jenħtieġ li l-kontropartijiet jaqblu mingħajr dubju dwar it-tip ta' SFT konkluzi.
15. SFT tkun rapportabbli meta jkun hemm żewġ kontropartijiet għaliha, jew meta waħda mill-partijiet fl-SFT tkun individwu li mhuwix imprima u l-oħra tkun kontroparti kif definita fl-SFTR. Ma hemmx SFT b'aktar minn par ta' kontropartijiet. Fil-każ ta' allokkazzjoni ta' self bejn żewġ riċevituri ta' kollateral jew aktar u żewġ fornituri ta' kollateral jew aktar, SFT hija ddefinita bħala kull self kollateralizzat ta' titoli, ta' flus jew ta' komoditajiet bejn żewġ kontropartijiet.
16. F'każ li l-kundizzjonijiet fil-paragrafu 12 jiġu ssodisfati, irrappettivament min-natura legali tagħhom, il-fondi ta' investiment jitqiesu li huma kontropartijiet għal SFT. B'mod speċifiku, fil-każ ta' sottofondi, b'mod simili għal dak li jsir skont l-EMIR, is-sottofondi normalment ikollhom LEI. F'dak il-każ jenħtieġ li jiġu rrapportati bħala kontroparti fuq bażi awtonoma. L-informazzjoni rilevanti dwar is-self u l-kollateral jenħtieġ li tirreferi għall-SFTs konkluzi minn dak is-sottofond. F'każ li s-sottofond ma jkunx parti għall-SFT, jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 4.17.
17. Fil-każ ta' SFTs ikklierjati, kull waħda mill-SFTs bejn is-CCP, il-membri tal-ikklierjar tagħha u l-klijenti ta' dawk, u l-bqija, tikkostitwixxi SFT separata u jenħtieġ li tiġi rrapportata b'UTI differenti. Meta l-SFT tiġi konkluzi f'ċentru tan-negozjar u kklirjata fl-istess jum, kif previst fl-Artikolu 2(2) tal-RTS dwar ir-rapportar, din għandha tiġi rrapportata wara li tkun ġiet ikklierjata, jiġifieri jenħtieġ li ma jiġux irrapportati l-give-ups u t-take-ups intermedji. Għal informazzjoni dettaljata dwar ir-rapportar ta' SFTs ikklierjati, jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 4.3.
18. Barra minn hekk, fil-każ ta' SFT fails-curing, is-CSD jenħtieġ li jirrapporta bħala l-kontropartijiet tiegħu l-partecipanti rilevanti tas-CSD u mhux lill-klijenti ta' dawk. Dan japplika wkoll meta l-SFT tiġi eżegwita kontra kont omnibus,
19. Għalhekk, hliet għat-tranzazzjonijiet inklużi fl-Artikolu 2(3) SFTR u dawk imsemmija fit-Taqsima 4.2.1, l-SFTs l-oħrajn kollha jenħtieġ li jiġu rrapportati kif spjegat fid-dettall fit-taqsima sussegwenti ta' dawn il-Linji Gwida.
20. Ta' min jinnota li l-SFTs imsemmija fl-Artikolu 2(3) huma rapportabbli skont ir-Regolament 600/2014.

#### 4.2.3 Aspetti relatati mar-repos

21. Fil-każ ta' self kollateralizzat f'aktar minn munita waħda, daww jikkostitwixxu SFTs separati u jenħtieġ li jiġu rrapportati b'UTIs separati. Ir-rapportar ta' kull repo jenħtieġ li jsir skont il-prinċipji ġenerali għar-rapportar ta' tranżazzjoni ta' riakkwist:
  - a. Irrapporta l-ammonti ta' kapital applikabbli u l-UTI u l-komponenti kollaterali individwali, jekk ikun hemm, għal kull munita separata; u
  - b. Irrapporta l-kollateral rilevanti fuq bażi ta' skopertura netta, jiġifieri dik li tkopri r-repos, iżda mhux speċifikament allokata lil xi waħda minnhom u żgura li din tista' tiġi assoċjata mal-kampijiet rilevanti.
22. Meta l-prezz tar-riakkwist jiġi espress f'munita differenti minn dik li fiha jiġi espress il-prezz tax-xiri, iżda xorta jirrigwarda l-istess repo, il-munita għall-komponent finali jenħtieġ li tiġi kkonvertita għall-munita ta' dak inizzjali għall-finijiet tar-rapportar tal-informazzjoni rilevanti dwar il-prezz u l-kapital. Jekk jogħġbok irreferi għal-linji gwida dwar l-użu tar-rati FX għar-rapportar tal-valuri tas-suq fit-Taqsima 4.13.1 biex tiżgura li tiġi ppreżentata ċifra konsistenti għal dan il-kamp.
23. Meta l-kollateral ta' repo jkun qed jiehu forma differenti ta' trasferiment, li tkun għadha parti mill-arranġamenti kollaterali li huma definiti skont id-Direttiva dwar il-Kollateral, jenħtieġ li l-kontropartijiet xorta waħda jirrapportaw bħala repo. Ir-repos konkluzi skont ir-regoli ta' ġurisprudenzjonijiet oħra, bħal Gentan repos, jenħtieġ li jiġu rrapportati kif xieraq u billi jiġu pprovvuti dettalji kompluti u preċiżi skont it-TS dwar ir-rapportar.
24. Ir-repos u r-retroriakkwisti konkluzi mis-CCPs sabiex jiġu investiti (i) assi proprji għall-fini ta' manutenzjoni tal-likwidità, jew (ii) assi tal-membri tal-ikklerjar ipprovvuti bħala margni, huma koperti mill-obbligu ta' rapportar skont l-Artikolu 4 tal-SFTR.
25. Ir-repos u r-retroriakkwisti jenħtieġ li jiġu rrapportati billi jintuża l-mudell XML tal-ISO 20022 applikabbli għal repo.

#### 4.2.4 Aspetti relatati mal-BSB/SBB

26. Ċerti BSB/SBB huma regolati bi ftehimiet bilaterali jew prinċipali. Madankollu, l-annessi speċifiċi li jkopru dawn l-SFTs huma differenti minn daww li jappartjenu għal repos u retroriakkwisti. Bla dubju, it-tip ta' SFT konkluzi huwa BSB/SBB.
27. Fejn il-BSB/SBB ikun regolat bi ftehim bilaterali jew prinċipali jew b'anness għal ftehim prinċipali, dan il-ftehim jenħtieġ li jiġi rrapportat fil-kampijiet rilevanti, jiġifieri l-kampijiet 9-11 tat-Tabella 2 dwar *Data* dwar self u kollateral.
28. Il-kontropartijiet jenħtieġ li jagħmlu hilitom biex jirrapportaw il-ftehimiet prinċipali li mhumiex inkluzi fl-ITS dwar ir-rapportar eżattament bl-istess mod. Barra minn hekk, f'dak li għandu x'jaqsam mal-ftehim prinċipali, il-kamp tal-Verżjoni tal-ftehim prinċipali jenħtieġ li jiġi rrapportat bil-verżjoni applikabbli għall-SFT li tkun qed tiġi konkluzi.
29. Meta l-kontropartijiet isibu li ċerti tipi ta' BSB/SBBs jiġu rrapportati aħjar bl-użu tal-mudell repo, fil-każ li ż-żewġ kontropartijiet jaqblu, il-kontropartijiet jenħtieġ li jużaw il-mudell repo biex jirrapportaw daww l-SFTs.

30. BSB/SBB jenħtiegħ li jiġi rrapportat billi jintuża l-mudell XML tal-ISO 20022 applikabbli għall-BSB/SBB.

#### 4.2.5 Aspetti relatati ma' għoti u teħid b'self ta' titoli

31. Mid-definizzjoni jsegwi li l-konklużjoni ta' SLB hija marbuta mat-trasferiment ta' titoli minn sellief lil mutwatarju. SLB ma jistax ikollhom aktar minn ISIN wieħed ittrasferit. Jekk fil-proċess ta' allokkazzjoni minn entitajiet terzi, bħal aġenti selliefa, ikun hemm aktar minn ISIN wieħed li għandu jiġi ttrasferit bejn par kontropartijiet partikolari, jenħtiegħ li tiġi rrapportata SFT differenti għal kull ISIN.
32. Peress li l-Artikolu 4(1) tal-SFTR jeħtiegħ ir-rapportar ta' konklużjonijiet, ta' modifika u ta' terminazzjoni tal-SFTs sa mhux aktar tard mill-jum ta' xogħol ta' wara, jenħtiegħ li jiġu rrapportati l-SFTs kollha li jkunu ġew konklużi. Dan jinkludi l-SFTs kollha li ġew iġġenerati minkejja li ma setgħux jiġu saldati.
33. Xi tipi ta' maniġers tal-assi ma ġewx ikkunsidrati fix-xenarji differenti ppreżentati. Dan jinkludi fondi li jaggregaw titoli fi grupp ta' assi u jistgħu jisilfuhom. Dawn il-fondi jinneozjaw permezz ta' sensar finanzjarju li jaġixxi bħala aġent u jislef titolu għal kwantità speċifika mill-grupp ta' assi tal-fondi. Tranżazzjoni diretta tiġi kkonfermata bejn il-kontroparti u l-grupp. Fl-aħħar tal-ġurnata ssir l-allokkazzjoni finali, u l-konfermi individwali jintbagħtu lil kull fond li jippartecipa fil-grupp. Id-dettalji jintbagħtu wkoll lill-kontroparti u s-saldu jseħħ permezz ta' trasferiment uniku mid-depożitarju komuni tal-fondi kkonċernati kollha. F'dan il-każ partikolari, u skont il-prinċipju ġenerali inkluż fil-paragrafu 15, jenħtiegħ li l-kontropartijiet jirrapportaw SFT separata għal kull par kontropartijiet u ISIN lit-TRs.
34. Fil-każ ta' self ta' titoli f'arranġament ta' CCPs bi grupp ta' assi ma jkunx possibbli li tiġi rrapportata attività taċ-ċiklu tal-ħajja tal-istess ġurnata fejn il-pożizzjonijiet ta' self netti godda biss jiġu allokatil lil mutwatarju u sellief fi tmiem il-ġurnata. Għalhekk, f'arranġament ta' CCPs, is-self tal-istess ġurnata jenħtiegħ li jiġi rrapportat, għalkemm jista' ma jkunx meħtiegħ li jiġi allokat kollateral għalihom. Il-kollateral jenħtiegħ li jiġi rrapportat għall-SLBs l-oħrajn kollha, fejn il-Kamp (2.72) "Marka ta' SL mhux kollateralizzata" ikun ippopolat b'"falz", inkluż is-self ġdid nett saldat li jrid jiġi rrapportat fir-rapport tal-kummerċ (f'S+1).
35. L-SLB jenħtiegħ li jiġi rrapportat billi jintuża l-mudell XML tal-ISO 20022 applikabbli għall-SLB.
36. L-SLBs immexxija mill-flus, magħrufa wkoll bħala "self retro ta' titoli", iridu jiġu rrapportati bħala repo. Meta SLB immexxija mill-flus jiġu rrapportati bl-użu tal-kampijiet tar-repo, ta' min jinnota li t-tip ta' Ftehim prinċipali jenħtiegħ li jirrifletti l-ftehim sottostanti rilevanti, eż. GMSLA.

#### 4.2.6 Aspetti relatati ma' SFTs li jinvolvu komoditajiet

37. L-eżekuzzjoni tal-SFT jenħtiegħ li tkun strutturata b'tali mod li s-sid benefiċjarju la jitlef is-sjieda ekonomika tiegħu tal-komoditajiet, u lanqas ma jieħu riskju tas-suq ġdid fil-komodità.

38. Tranżazzjonijiet repo/ta' retroriakkwist li jinvolvu komoditajiet huma kkaratterizzati mill-preżenza ta' ftehim (ta' riakkwist). Il-komoditajiet jistgħu jiġu ttrasferiti permezz ta' trasferiment ta' titolu ċar jew rahan.
39. Madankollu, meta f'konformità mal-ambitu tal-SFTs li jinvolvu komoditajiet, meta l-bejgħ u r-riakkwist ma jikkwalifikawx bħala repo, jenħtieġ li dan ikun BSB minflok.
40. Fi tranżazzjoni ta' għoti u teħid b'self ta' komoditajiet (SLB), ir-riċevitur tal-kollateral ikun il-parti li tislef il-komoditajiet u min jagħti l-kollateral jieħu b'self il-komoditajiet. Dan huwa differenti mill-każ ta' repo/retroriakkwist u ta' BSB/SBB, fejn il-komodità titqies bħala kollateral fit-tranżazzjoni.
41. Meta jirrapportaw l-SFTs li jinvolvu komoditajiet, b'segwitu għall-ftehimiet prinċipali rilevanti, il-kontropartijiet jenħtieġ li jivvalutaw il-punt sa fejn it-tip ta' SFT li tinvolvi komoditajiet li huma qed jirrapportaw jista' joqgħod fil-kampijiet applikabbli għal dik l-SFT. Dan suppost jgħin biex jiġi ddeterminat jekk it-tranżazzjoni teħtieġx li tiġi rrapportata bħala tranżazzjoni ta' għoti jew teħid b'self ta' komoditajiet, jew bħala repo/SBB jew retroriakkwist/BSB ikollateralizzati b'komoditajiet.
42. Barra minn hekk, l-SFTs kollha kif iddefiniti fl-Artikoli 3(7) sa 3(10) SFTR, ħlief self ta' margni, jinkludu referenza għall-użu possibbli ta' komoditajiet bħala parti mill-SFT. Il-BSB/SBB jillimita l-użu ta' komoditajiet għal xirjiet u għal bejgħ sussegwenti bejn iż-żewġ kontropartijiet (mingħajr intermedjarju tas-suq), filwaqt li t-tranżazzjonijiet ta' għoti u teħid b'self ta' komoditajiet u r-repos jippermettu kemm trasferiment ta' titolu kif ukoll arranġamenti ta' rahan. Għalhekk, il-kontropartijiet jenħtieġ li jipopplaw it-tip ta' arranġament kollaterali fil-Kamp 2.20 Metodu użat għall-provvista ta' kollateral, kif xieraq.
43. L-SFTs li jinvolvu komoditajiet jistgħu kultant ikunu parti minn strutturi aktar kumplessi li jistgħu jinkludu derivattivi, bħal futuri u opzjonijiet. Jenħtieġ li jiġu rrapportati biss il-partijiet tal-istruttura ġenerali li tkun l-SFT. Id-derivattivi użati fi strutturi bħal dawn jistgħu jiġu rrapportati skont l-EMIR u/jew l-MIFID u/jew l-REMIT.
44. Rigward it-tifsira ta' komoditajiet ekwivalenti u ta' komoditajiet issostitwiti, l-ESMA tiċċara dan li ġej:
  - a. il-komoditajiet ekwivalenti huma l-istess tip ta' komoditajiet b'karatteristiċi u/jew bi speċifikazzjonijiet simili li jistgħu jissostitwixxu l-komoditajiet oriġinali fil-komponent tar-ritorn kif miftiehem kuntrattwalment.
  - b. komoditajiet issostitwiti huma komoditajiet li huma mirhuna bħala kollateral bħala sostituzzjoni għall-komoditajiet li oriġinarjament kienu mirhuna bħala kollateral taħt l-istess tranżazzjoni.

#### 4.2.6.1 SFTs li jinvolvu l-enerġija

45. Tranżazzjoni (eż. akkwist bil-patt ta' rivendita ta' gass minn żoni b'għanijiet ta' finanzjament (alternattivi)) tista' tkun tranżazzjoni rapportabbli skont l-REMIT b'perjodu ta' żmien ta' rapportar ta' T+30 u, fl-istess ħin, SFT rapportabbli sa T+1.
46. Għalhekk, meta dawn it-tipi ta' tranżazzjonijiet ikunu ċari biżżejjed għal klassifikazzjoni mhux ambigwa bħala SFTs użati biex jifinanzjaw il-komoditajiet, dawn ikunu rapportabbli skont il-mudell tar-rapportar rilevanti.

#### 4.2.7 Aspetti relatati ma' self b'marġni

47. Huwa mistenni li teżisti tranżazzjoni ta' self b'marġni waħda biss bejn kull par kontropartijiet f'mument partikolari, ħlief meta l-entitajiet ikunu ftiehem kuntrattwalment biex ikollhom aktar minn munita bażi waħda u s-self b'marġni jiġi ddetminat fir-rigward ta' kull waħda minnhom, f'liema każ jenħtieġ li jkun hemm tranżazzjoni ta' self b'marġni għal kull munita bażi. Din l-SFT tkun relatata ma' kwalunkwe self b'marġni jew valur qasir tas-suq fil-munita bażi.
48. UTIs għal self b'marġni jenħtieġ li jiġu ġġenerati biss meta l-facilità tkun ġiet prelevata tal-inqas darba. F'każijiet fejn ftehim ta' senserija prima jkun ġie ffirmat iżda l-facilità tkun għadha ma ġietx prelevata, ma jkun meħtieġ l-ebda rapport peress li ma jkun għad hemm l-ebda SFT.
49. Jekk fi kwalunkwe żmien kemm is-self b'marġni kif ukoll il-valur qasir tas-suq jinżlu għal zero, jiġifieri ma jkun qed jiġi estiż l-ebda kreditu fi flus jew f'titoli, il-kollateral tal-klijent miżmum mis-sensar prinċipali ma jibqax jikkollateralizza skopertura għal SFT. Ikun qed jinżamm għal obligazzjonijiet oħra mhux tal-SFT. Is-sensar prinċipali u l-klijent jenħtieġ li (i) jirrapportaw il-kollateral fi flus għal zero biex jindikaw li ma hemmx kollateral u (ii) jieqfu milli jirrapportaw kollateral sakemm jerġġu jkunu jeżistu self b'marġni jew skopertura ta' SMV.
50. Jenħtieġ li t-tranżazzjoni ma tiġix irrapportata bit-Tip ta' azzjoni "ETRM", iżda b'tip ta' azzjoni "MODI". F'dan il-każ, messaġġ ta' aġġornament tal-kollateral (COLU) li jindika zero bħala valur għall-kollateral fi flus huwa mistenni li jiġi riċevut ukoll sabiex tiġi evitata kwalunkwe rappreżentazzjoni ħażina tal-kollateral li jkun qed jintuża. Għal rapportar ta' kollateral zero, jekk jogħġbok irreferi għat-taqsimha 5.4.4.
51. Fil-każ ta' self b'marġni, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jirrapportawx komponenti kollaterali li huma differenti minn titoli u flus.
52. Jenħtieġ li r-rapportar tal-valur qasir tas-suq tal-klijent ma jkunx ibbażat fuq ir-rikonossiment fil-kontabilità (jiġifieri jew id-data tan-negozju jew il-kontabilità tad-data tas-saldu) mis-sensar prinċipali (IAS 39.38 Strumenti Finanzjarji: Rikonossiment u Kejl). Ir-rapportar tal-valur qasir tas-suq jenħtieġ li jsir bl-istess mod li bih jiġi rrapportat is-saldu tas-self u tal-kollateral. B'hekk, il-kontropartijiet jenħtieġ li jikkalkolaw il-valur qasir tas-suq fuq il-baži tad-data tas-saldu maħsuba u t-titoli li huma mistennija li jiġu kkonsenjati.
53. Barra minn hekk, meta l-portafoll tal-klijent ta' senserija prima ma jkunx jinvolvi n-negozjar ta' titoli, ir-rapportar tal-estensjoni tal-kreditu lil dawn il-klijenti ma jkollu l-ebda valur mill-perspettiva tal-SFTR u jenħtieġ li jiġi evitat għall-prevenzjoni tal-ġbir ta' ammonti kbar ta' informazzjoni irrilevanti.



### 4.3 Rapportar ta' SFTs ikklirjati minn CCP

54. Ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjonijiet huwa applikabbli għal SFTs ikklirjati minn CCP u huwa fakultattiv u komplementari għar-rapportar fil-livell tat-tranzazzjonijiet. Ir-rapporti fil-livell tal-pożizzjonijiet jistgħu jiġu sottomessi meta jiġu ssodisfati ċerti kundizzjonijiet<sup>1</sup>.
- L-arrangament legali huwa tali li r-riskju jkun fil-livell tal-pożizzjonijiet, ir-rapporti kummerċjali kollha huma relatati ma' prodotti li huma funġibbli ma' xulxin, u l-kummerċ individwali jkun ġie ssostitwit mill-pożizzjoni. Dan huwa l-każ meta n-novazzjoni ssejtni wara n-nettjar ta' negozji individwali, il-pożizzjoni netta tirriżulta f'kuntratt ġdid, u jiġi ġġenerat UTI ġdid għaliha. Dan jista' jkun il-każ, pereżempju, bejn membru tal-ikklirjar u CCP.
  - In-negozji oriġinali, jiġifieri fil-livell tat-tranzazzjonijiet, ikunu ġew irrapportati b'mod korrett. Mhuwiex permissibbli li jiġu rrapportati biss pożizzjonijiet.
  - Avvenimenti oħra li jaffettwaw il-kampijiet komuni fir-rapport tal-pożizzjoni jiġu rrapportati b'mod separat.
  - Ir-rapporti kummerċjali oriġinali (il-punt b aktar 'il fuq) u r-rapporti relatati ma' avvenimenti oħra (il-punt c aktar 'il fuq), fejn applikabbli, ikunu laħqu "stat finali tal-ħajja" xieraq. Dan jenħtieġ li jinkiseb billi jintbagħtu messaġġi ta' terminazzjoni bikrija u mbagħad tiġi rrapportata l-pożizzjoni netta jew bħala pożizzjoni ġdida jew bħala aġġornament għall-pożizzjoni eżistenti.
  - Ir-rapport tal-pożizzjoni jsir korrettament billi jimtlew il-kampijiet applikabbli kollha fid-*data* speċifika għall-kontropartijiet u dwar it-tranzazzjonijiet, u, kif xieraq, fit-tabella ta' kampijiet dwar l-użu mill-ġdid tal-margini u tal-kollateral.
55. Jekk dawn il-kundizzjonijiet jiġu ssodisfati, ir-rapportar ta' aġġornamenti sussegwenti, inklużi aġġornamenti ta' valwazzjoni, aġġornamenti tal-kollateral u modifiki oħra u avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja jistgħu jiġu applikati għar-rapport tal-pożizzjoni (bħala modifiki, eċċ., u b'żamma tal-istess valur tal-UTI fuq il-pożizzjoni ikklirjata mis-CCP) u mhux għar-rapporti tan-negozji/tal-avvenimenti oriġinali.
56. Ir-rapport tal-livell tal-pożizzjonijiet jenħtieġ li jkun identifikat bil-UTI tiegħu stess, li huwa identifikatur persistenti ta' dik il-pożizzjoni, jiġifieri ma jinbidilx wara kwalunkwe modifika fil-pożizzjoni.
57. Huwa mtenni li sabiex isejtni ir-rapportar fil-livell tal-pożizzjonijiet, l-SFTs ikklirjati l-ewwel jenħtieġ li jiġu rrapportati fil-livell tat-tranzazzjonijiet bit-*Tip* ta' Azzjoni "POSC" (anki jekk ikklirjati fl-istess jum), u wara dan biss l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja jkunu jistgħu jiġu rrapportati fil-livell tal-pożizzjonijiet. Jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 5.2.1 għax-xenarju li juri l-passi meħtieġa għar-rapportar fil-livell tal-pożizzjonijiet.

---

<sup>1</sup> Jekk jogħġbok irreferi għall-Artikolu 84 tas-CP dwar il-Linji Gwida dwar ir-rapportar skont l-SFTR

## 4.4 Allokkazzjoni tar-responsabbiltà skont l-Artikolu 4(3) SFTR

### 4.4.1 Każ ġenerali

58. L-NFC jenħtieġ li tikkomunika ma' FC jekk tikkwalifikax bħala NFC żgħira jew le, kif ukoll taġġorna lill-FC dwar kwalunkwe tibdil potenzjali fl-istatus tagħha.

### 4.4.2 Pajjiż terz - Kontropartijiet Finanzjarji (TC-FC)

59. Ladarba l-ekwivalenza ta' TC partikolari tiġi ddikjarata mill-KE, fil-każ ta' SFT konkluzi bejn TC-FC, b'fergħa fl-Unjoni, u SME-NFC, fejn it-TC-FC u l-SME-NFC ikunu ssodisfaw l-obbligi ta' rapportar ta' dak il-pajjiż terz, la t-TC-FC u lanqas l-SME-NFC ma jenħtieġ li jirrapportaw l-SFT skont l-SFTR.

60. Fir-rigward tal-SFTs konkluzi bejn TC-FC barra mill-kamp ta' applikazzjoni tal-SFTR (jiġifieri mhux koperti bl-Artikolu 2(1)(a)(ii) tal-SFTR) u SME NFC, tali SFTs jenħtieġ li jew jiġu rrapportati direttament mill-SME NFC lil TR, jew inkella jsir użu mill-possibbiltà għal delega inkluża fl-Artikolu 4(2).

### 4.4.3 Fondi

61. Fejn l-allokkazzjoni tar-responsabbiltà skont l-Artikolu 4(3) SFTR ma tkunx applikabbli għall-AIFM, jiġifieri l-AIFM ma jkunx soġġett għall-SFTR, ir-responsabbiltà li l-SFTs jiġu rrapportati lil TR tibqa' tal-fond.

## 4.5 Delega volontarja tar-rapportar

62. F'każijiet ta' delega tar-rapportar, il-kontroparti li tiddelega (koperta bl-obbligu ta' rapportar) jenħtieġ li tipprovdi lill-entità li tissottometti r-rapport bid-dettalji kollha tal-SFT b'mod puntwali, u l-kontroparti tkun responsabbli li tiżgura li dawk id-dettalji jkunu korretti. Fl-istess ħin, l-entità li tissottometti r-rapport jenħtieġ li tiżgura li l-kontropartijiet li jirrapportaw ikunu informati dwar id-*data* rrapportata f'isimhom, ir-riżultati tal-ipproċessar tad-*data* tat-TR rilevanti u, jekk ikun hemm, kwistjonijiet rilevanti dwar ir-rapportar jew il-kwalità tad-*data*.

## 4.6 Applikazzjoni tal-obbligi ta' rapportar tal-SFTR għal SFTs konkluzi minn fergħat

4.6.1 Applikazzjoni tal-obbligi ta' rapportar tal-SFTR għal SFTs konkluzi minn entitajiet mhux fl-UE b'fergħat fl-UE

63. F'konformità mal-iskop tal-SFTR u b'konsistenza mal-EMIR, l-ESMA tqis li l-konkluzjoni tat-terminu għandu jinftehem bħala relatat mal-kontroparti għat-tranzazzjoni, jiġifieri l-kontroparti fejn l-SFT tkun irregistrata.



#### 4.6.2 Determinazzjoni tal-SFTs rapportabbli meta jiġu konklużi minn fergħat

64. Tabella1 tispjega x'jenħtieġ li jkun irrapportat b'referenza għall-fergħat ta' kontropartijiet li jirrapportaw.
65. Il-kolonna finali intitolata "Rapportabbli skont I-SFTR" tirreferi għal jekk it-tranzazzjoni tkunx soġġetta għall-obbligu ta' rapportar skont I-SFTR. Jekk ma tkunx rapportabbli, jenħtieġ li t-tranzazzjoni ma tiġix irrapportata, irrISPettivament mil-lokalità tal-kontropartijiet/tal-fergħat. Ir-ringieli tat-Tabella1 li huma ħomor juru xenarji li qatt ma jkunu rapportabbli skont I-SFTR.
66. Huwa importanti li wieħed jifhem li għal ċerti xenarji, l-eżistenza tal-obbligu ta' rapportar għall-kontroparti ma tfissirx li l-SFT trid bilfors tiġi rrapportata, u viċi versa, kif spjegat fit-Tabella1. Pereżempju, tranzazzjonijiet konklużi bejn żewġ fergħat tal-istess entità ġuridika, anke meta l-kontroparti (identifikata bl-LEI 1) tkun soġġetta għall-obbligu ta' rapportar, ma jkunux rapportabbli, kif stabbilit fil-kolonna finali. Ir-raġuni għal dan hija li ma jkunx hemm żewġ kontropartijiet, iżda pjuttost żewġ estensjonijiet tal-istess waħda.
67. Anki meta fergħa jkollha LEI, il-Kampijiet 1.3 "Kontroparti li tirrapporta" u 1.11 "Kontroparti oħra" jenħtieġ li jiġu ppopolati bl-LEI tal-kwartieri ġenerali rilevanti, filwaqt li l-informazzjoni tal-fergħa rilevanti jenħtieġ li tiġi rrapportata fil-Kampijiet 1.17 "Fergħa tal-kontroparti li tirrapporta" u 1.8 "Fergħa tal-kontroparti l-oħra". Il-Kamp 1.12 "Pajjiż tal-kontroparti l-oħra" jenħtieġ li jiġi ppopolat bil-kodiċi tal-pajjiż tal-kwartieri ġenerali, u mhux tal-fergħa.

Tabella1 - Rapportar mill-fergħat									
	Reporting Counterparty	Country of the reporting counterparty	Country of the branch of the reporting counterparty	Reporting obligation	Other Counterparty	Country of the other counterparty	Country of the branch of the other counterparty	Reporting obligation	Reportable under SFTR
SFT1	LEI1	EU		YES	LEI1	EU	AT	YES	NO
SFT2	LEI1	EU		YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT3	LEI1	EU	BE	YES	LEI1	EU	AT	YES	NO
SFT4	LEI1	EU	BE	YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT5	LEI1	EU	CH	YES	LEI1	EU	US	YES	NO
SFT6	LEI1	EU		YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT7	LEI1	EU		YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT8	LEI1	EU		YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT9	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT10	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT11	LEI1	EU	BE	YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT12	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU		YES	YES
SFT13	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU	AT	YES	YES
SFT14	LEI1	EU	US	YES	LEI2	EU	US	YES	YES
SFT15	LEI1	EU		YES	LEI3	US		NO	YES
SFT16	LEI1	EU		YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT17	LEI1	EU		YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT18	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US		NO	YES
SFT19	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US	CH	NO	YES

**Tabella1 - Rapportar mill-fergħat**

	Reporting Counterparty	Country of the reporting counterparty	Country of the branch of the reporting counterparty	Reporting obligation	Other Counterparty	Country of the other counterparty	Country of the branch of the other counterparty	Reporting obligation	Reportable under SFTR
SFT20	LEI1	EU	BE	YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT21	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US		NO	YES
SFT22	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US	CH	NO	YES
SFT23	LEI1	EU	US	YES	LEI3	US	AT	YES	YES
<b>SFT24</b>	<b>LEI4</b>	<b>US</b>		<b>NO</b>	<b>LEI3</b>	<b>US</b>		<b>NO</b>	<b>NO</b>
SFT25	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US		NO	YES
<b>SFT26</b>	<b>LEI4</b>	<b>US</b>	<b>CH</b>	<b>NO</b>	<b>LEI3</b>	<b>US</b>		<b>NO</b>	<b>NO</b>
SFT27	LEI4	US		NO	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT28	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US	AT	YES	YES
SFT29	LEI4	US	CH	NO	LEI3	US	AT	YES	YES
<b>SFT30</b>	<b>LEI4</b>	<b>US</b>		<b>NO</b>	<b>LEI3</b>	<b>US</b>	<b>CH</b>	<b>NO</b>	<b>NO</b>
SFT31	LEI4	US	AT	YES	LEI3	US	CH	NO	YES
<b>SFT32</b>	<b>LEI4</b>	<b>US</b>	<b>CH</b>	<b>NO</b>	<b>LEI3</b>	<b>US</b>	<b>CH</b>	<b>NO</b>	<b>NO</b>

Note: AT and BE are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for EU member states, US and CH are ISO 3166-1 Alpha-2 codes for non-EU member states.

All codes are included for illustrative purposes.

If the country of the branch is not provided, it should be interpreted that the SFT was concluded by the headquarters.

The reporting of the data elements in italics might not be required.

## 4.7 Rapportar minn NFC

68. L-ESMA tirrikonoxxi li LEI jista' jkun indisponibbli f'ċerti xenarji; madankollu, dan ix-xenarju ma japplikax għal NFC stabbilita fl-UE. L-entitajiet kollha soġġetti għal SFTR jenħtieġ li jużaw LEI għall-identifikazzjoni tal-entitajiet imsemmija fil-kampijiet tad-*data* rilevanti.
69. Meta l-SFT tiġi konkluża bejn żewġ NFCs, it-tnejn li huma jenħtieġ li jirrapportawha lil TR, għalkemm jistgħu jagħmlu użu mill-possibbiltà li jiddelegaw ir-rapportar skont l-Artikolu 4(2) lil waħda minnhom jew lil parti terza.

## 4.8 Tipi ta' azzjoni

### 4.8.1 Tipi ta' azzjoni applikabbli

70. Il-kontropartijiet għal SFT jenħtieġ li jirrapportaw il-konklużjoni, il-modifika u t-terminazzjoni ta' SFT. F'każ li l-ebda dettall tal-SFT, kif espress fil-kampijiet tad-*data*, ma jkun inbidel, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jirrapportawx mill-ġdid id-dettalji tal-SFT.
71. L-aġġornamenti tal-valwazzjoni jenħtieġ li jiġu rrapportati biss meta jkun hemm tibdil fil-valur tat-titoli fuq is-self jew użati bħala kollateral.
72. Fil-każ ta' rapportar tal-kollateral, il-kontropartijiet jenħtieġ li ma jirrapportaw l-ebda bidla tal-istess ġurnata fil-kollateral, iżda biss l-istat fi tmiem il-jum.

73. It-tipi ta' azzjoni huma reċiprokament esklussivi. Ir-rapportar b'kull tip ta' azzjoni differenti għandu informazzjoni differenti għall-awtoritajiet kemm mill-perspettivi tan-negozju kif ukoll minn dawk tal-ġestjoni tad-*data*. Għalhekk, il-kontropartijiet jenħtieġ li jagħmlu fiha lihom biex jirrapportaw it-tip ta' azzjoni korretta.

#### 4.8.2 Rapportar b'ħarsa sfiha kontra rapportar parzjali tal-emendi għal SFTs

74. Fil-każ ta' emendi li għandhom x'jaqsmu mal-SFTs, kemm l-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja kif ukoll il-korrezzjonijiet, jenħtieġ li l-kontropartijiet jissottomettu messaġġi li jkun fihom il-kampijiet kollha applikabbli, inklużi dawk li ma jkunux inbidlu, li jkunu għadhom jippermettu r-rapportar separat bejn id-*data* dwar is-self u l-kollateral.
75. Barra minn hekk, ta' min jinnota li l-valwazzjoni, il-kollateral, il-marġni u l-aġġornamenti tal-użu mill-ġdid huma rapporti ta' ħarsa lejn l-istat ta' kuljum, f'liema każ ikunu meħtieġa l-kampijiet rilevanti kollha. Barra minn hekk, minħabba r-rapportar ta' kuljum, huwa mistenni li kull wieħed minn dawn ir-rapporti ta' ħarsa lejn l-istat jirriflettu l-istat fl-aħħar tal-jum, filwaqt li jitqiesu l-emendi rilevanti kollha li jkunu seħħew matul dak il-jum. Konsegwentement, u b'kunsiderazzjoni tal-iskadenza għar-rapportar T+1, kontroparti mhijiex mistennija tippreżenta rapport ta' korrezzjoni għall-kollateral, għall-valwazzjoni, għall-marġni jew għall-użu mill-ġdid għall-jum kurrenti jew għall-jum ta' xogħol ta' qabel. Għall-kuntrarju, il-korrezzjonijiet tal-kollateral, tal-valwazzjoni, tal-marġni jew tal-użu mill-ġdid jenħtieġ li jiġu ppreżentati biss għad-*data* storika fil-każ fejn ikun ġie identifikat żball fl-informazzjoni rrapportata wara l-iskadenza għar-rapportar.
76. Fil-każ tal-informazzjoni li tikkonċerna l-parti tas-self tat-tranzazzjoni, kull modifika jenħtieġ li tiġi rrapportata b'ħala tali u b'mod separat mill-korrezzjonijiet tad-*data* dwar is-self. Fil-każ ta' diversi modifiki li jseħħu fl-istess ġurnata, dawn jistgħu jiġu rrapportati f'rapport wieħed sal-punt li dan ir-rapport jirrifletti b'mod preċiż it-tibdiliet kollha.
77. Il-kampijiet eżatti li huma meħtieġa għal kull tip ta' rapport huma speċifikati fir-regoli ta' validazzjoni.
78. Fir-rigward ta' ċerti kampijiet li jenħtieġ li ma jiġux immodifikati (eż. Kronogramma ta' eżekuzzjoni), it-TRs mhumiex mistennija jivverifikaw li l-kontenut ta' dawn il-kampijiet ma jkunx emendat meta jiġi rrapportat b'Tip ta' Azzjoni "MODI" sakemm ma jkunx speċifikat mod ieħor fir-regoli ta' validazzjoni għal kamp partikolari.

#### 4.8.3 Sekwenza bejn it-tipi ta' azzjoni għat-tipi differenti ta' messaġġi

79. It-Tabella 2, it-Tabella 3 u t-Tabella 4 jipprovdu informazzjoni dwar il-kombinazzjonijiet differenti tas-sekwenza tat-tipi ta' azzjoni li mhumiex ipprojbti mir-regoli ta' validazzjoni<sup>2</sup>. L-informazzjoni ppreżentata fit-Tabella 2 tapplika għal rapportar fil-livell tal-kummerċ u tal-pożizzjonijiet<sup>3</sup>, filwaqt li t-Tabella 3 u t-Tabella 4 huma speċifikament relatati mar-rapportar ta' marġnijiet għal SFTs ikklirjati minn CCP u mar-rapportar tal-użu mill-ġdid.

<sup>2</sup> Tibdiliet futuri fid-definizzjoni tar-regoli ta' validazzjoni jistgħu jhallu impatt fuq il-kontenut tat-tabella.

<sup>3</sup> Il-komponent ta' pożizzjoni ma japplikax għar-rapportar tal-livell ta' rapportar tal-pożizzjonijiet

**Tabella 2 - Data dwar il-Kontroparti, is-Self u I-Kollateral**

		Following Steps							
		New	Error	Termination	Modification	Valuation	Collateral	Correction	Position Component
Previous steps	New		x	x	x	x	x	x	
	Error								
	Termination		x		x	x	x	x	
	Modification		x	x	x	x	x	x	
	Valuation		x	x	x	x	x	x	
	Collateral		x	x	x	x	x	x	
	Correction		x	x	x	x	x	x	
	Position Component		x					x	

**Tabella 3 - Aġġornament tal-margni**

		Following step			
		New	Error	Margin update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Margin update		x	x	x
	Correction		x	x	x

**Tabella 4 - Data dwar l-Użu mill-Ġdid, l-Investment mill-Ġdid fi Flus Kontanti u s-Sorsi ta' Finanzjament**

		Following step			
		New	Error	Reuse update	Correction
Previous step	New		x	x	x
	Error				
	Reuse update		x	x	x
	Correction		x	x	x

80. Meta jiġu applikati t-Tabella 2, it-Tabella 3 u t-Tabella 4, huwa importanti li wieħed jifhem li dawn jirrapprezentaw tipi ta' azzjoni li jistgħu jiġu rrapportati fi kwalunkwe ħin ladarba jkun gie pprezentat tip ta' azzjoni ieħor, aktar milli l-pass eżatt li jmiss permess. Bħala eżempju, wara li ntbagħat rapport bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", jistgħu jintbagħtu biss "Korrezzjoni" jew "Żball". Madankollu, wara li tintbagħat "Korrezzjoni", ikun permess kwalunkwe tip ieħor ta' rapport. Tista' tqum mistoqsija rigward jekk entità li tkun bagħtet rapport bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni" u wara bagħtet "Korrezzjoni" għall-istess UTI, tistax tkompli tibgħat rapporti b'tipi oħra ta' azzjoni. It-twegiba hija le. It-tip ta' azzjoni "Korrezzjoni" ma jikkancellax/ma jwaqqafx l-applikazzjoni tar-restrizzjonijiet loġiċi kkawżati mill-preżentazzjoni preċedenti tar-rapport bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni". Għalhekk, dik l-entità xorta tista' tissottometti biss "Żball" jew "Korrezzjoni" oħra għall-istess tip ta' azzjoni. Bl-istess mod, mhuwiex meħtieġ li tiġi tterminata mill-ġdid l-SFT bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija" wara li tiġi pprezentata korrezzjoni għal SFT li tkun ġiet itterminata qabel (peress li l-"Korrezzjoni" ma għandhiex impatt fuq l-istatus mhux pendenti tal-kummerċ).
81. Ir-raġuni għaliex "Żball" u "Korrezzjoni" huma l-uniċi tipi ta' azzjoni aċċettabbli wara rapportar bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", hija li ladarba SFT tkun inkluża fil-pożizzjoni, ir-rapporti sussegwenti kollha (inklużi aġġornamenti tal-kollateral) jenħtieġ li jsiru fil-livell tal-pożizzjonijiet. Għalhekk, ir-rapporti jenħtieġ li jiġu sottomessi b'UTI differenti (dak tal-pożizzjoni), u s-sekwenza korretta ta' dawn ir-rapporti għal dik il-pożizzjoni jenħtieġ li tiġi vvalidata wkoll.
82. Ir-rapporti tal-SFT jenħtieġ li jintbagħtu fis-sekwenza kronoloġika li fiha seħħew l-avvenimenti, f'konformità mar-rekwiżiti stabbiliti fl-ITS. Madankollu, huwa rikonoxxut li fil-każijiet li fihom entità tonqos milli tirrapporta fil-ħin jew issir konxja tas-sottomissjoni ta'

informazzjoni skorretta fil-passat, l-entità jenħtieġ li tibgħat ir-rapporti b'dati tal-avvenimenti passati biex b'hekk tkisser l-ordni kronologiku.

83. Madankollu, it-TRs jenħtieġ li jirrevedu d-“Data tal-avveniment” biss sa fejn jivverifikaw li din ma tkunx data futura (dan huwa stipulat b'mod esplicitu fir-regoli ta' validazzjoni) u:
  - a. fil-każ ta' dati ta' avvenimenti “passati” (jiġifieri anqas mid-data ta' rapportar -1), dawn l-avvenimenti ma jbidlux it-tranzazzjonijiet wara l-maturità jew it-terminazzjoni tagħhom, jiġifieri d-data tal-avveniment irrapportata tiġi qabel id-data ta' maturità u, jekk ippopolata, id-data tat-terminazzjoni (dan huwa rifless ukoll fir-regoli ta' validazzjoni). It-TRs jenħtieġ li jivverifikaw ukoll li l-modifiki mibgħuta b'data ta' avveniment fil-passat ma jbidlux id-data ta' maturità rrapportata qabel. Barra minn hekk, it-TRs jenħtieġ li ma japplikawx il-bidla rrapportata għar-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju attwali (jekk it-tranzazzjoni tkun għadha pendenti) u lanqas ir-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju preċedenti tad-data li għaliha ġie rrapportat l-avveniment.
  - b. fil-każ ta' dati ta' avvenimenti ekwivalenti għad-data ta' rapportar jew għall-jum ta' qabel id-data ta' rapportar, it-TR jenħtieġ li japplika t-tibdiliet għar-Rapport dwar l-Istat tan-Negozju abbażi tas-sekwenza tas-sottomissjonijiet.
84. It-TRs jenħtieġ li jipprovdu r-rapporti ta' attività kummerċjali aċċettati kollha lill-awtoritajiet, irrispettivament mid-data tal-avveniment.
85. It-TRs jenħtieġ li jivvalidaw is-sekwenza korretta tar-rapporti abbażi tal-ordni tas-sottomissjoni tagħhom, irrispettivament mill-kontenut tal-Kamp “Data tal-avveniment”.
86. Minhabba li jistgħu jiġu rrapportati xi avvenimenti tal-passat għan-negozji li jkunu mmaturaw jew li ġew itterminati, huwa permess li jintbagħtu “Modifika”, “Aġġornament tal-valwazzjoni” jew “Aġġornament tal-kollateral” wara t-“Terminazzjoni/terminazzjoni bikrija” (dment li d-data tal-avveniment tkun qabel jew fid-data ta' maturità/terminazzjoni) li hija riflessa fit-Tabella 2.
87. Jenħtieġ li jiġi nnotat li s-sostituzzjonijiet ta' kollateral wara l-avveniment ta' terminazzjoni mhumiex mistennija jiġu rrapportati (sakemm it-terminazzjoni ma tiġix ikkanċellata). Għalhekk, it-terminazzjoni jenħtieġ li ma tiġix irrapportata qabel id-data effettiva tat-terminazzjoni (jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 4.9.5 għal aktar dettalji dwar ir-rapportar tat-terminazzjonijiet).
88. F'każ li numru ta' sottomissjonijiet preċedenti ġew irrifjutati minn TR, il-kontroparti jenħtieġ li tikkoreġi u terġa' tibgħathom malajr kemm jista' jkun u filwaqt li żżomm l-ordni kronologiku tal-avvenimenti. Fil-każ fejn dawn ir-rapporti preċedenti jikkonċernaw avvenimenti li seħħew fid-data ta' rapportar jew jum qabel u, għalhekk, jiġu kkunsidrati mit-TR għall-fini li jiġi pprovdut Rapport dwar l-Istat tan-Negozju (f'konformità mal-paragrafu 83 aktar 'il fuq), il-kontroparti jista' jkun jeħtiġilha wkoll li terġa' tissottometti l-aħħar rapport(i) biex ir-rekord tat-tranzazzjoni jiġi pprezentat fl-aktar stat aġġornat.
89. Fir-rigward tat-tip ta' azzjoni “Żball”, huwa importanti li jiġi nnotat li ladarba jiġi rrapportat, dan ma jstax jiġi kkanċellat jew inkella “jitreġġa' lura”. Għalhekk, jekk waħda miż-żewġ kontropartijiet tibgħat rapport b'dan it-tip ta' azzjoni bi żball, il-kontropartijiet jenħtieġ li jieħdu l-passi li ġejjin biex ikomplu jirrapportaw b'mod korrett:
  - a. Il-kontroparti l-oħra jenħtieġ li tibgħat ukoll rapport bit-tip ta' azzjoni “Żball” għall-istess UTI. Ma jkunx possibbli li dan l-UTI jintuża darb'oħra.

- b. Iż-żewġ kontropartijiet jenħtieġ li jaqblu dwar UTI ġdid għal din it-tranzazzjoni, jirrapportawha bit-tip ta' azzjoni "Ġdid" u l-UTI il-ġdid maqbul u jkomplu jirrapportaw kwalunkwe avveniment sussegwenti ta' ċiklu ta' ħajja bl-użu ta' dan il-UTI.
90. Eċċezzjoni waħda fejn sottomissjoni tat-tip ta' azzjoni "Żball" tista' ma tkunx teħtieġ il-kanċellazzjoni tat-tranzazzjoni mill-kontroparti l-oħra hija xenarju potenzjali li fih wieħed mill-kontropartijiet jirrapporta t-tranzazzjoni bi żball darbejn għal żewġ TRs differenti u jrid jikkancelła sottomissjoni żejda waħda biss. F'dan il-każ, din il-kontroparti jenħtieġ li tibgħat rapport bit-tip ta' azzjoni "Żball" lil TR wieħed, filwaqt li l-istess tranzazzjoni tibqa' miftuħa fit-TR l-ieħor u ż-żewġ kontropartijiet jistgħu jkomplu jirrapportaw bl-istess UTI.
91. Jenħtieġ li jiġi nnotat ukoll li din ir-restrizzjoni mhijiex applikabbli għar-rapportar ta' marġini u ta' użu mill-ġdid. Pereżempju, kontroparti tista' tirrapporta użu mill-ġdid bi żball (meta ma jkun sar l-ebda użu mill-ġdid) f'liema każ jenħtieġ li tippreżenta rapport dwar l-użu mill-ġdid bit-Tip ta' Azzjoni "Żball". Madankollu, dan m'għandux jipprevjeni lil din il-kontroparti milli tirrapporta użu mill-ġdid fi stadju aktar tard jekk ikun meħtieġ.

## **4.9 Rapportar f'waqtu ta' konkluzjoni, ta' modifika u ta' terminazzjoni ta' SFT**

### **4.9.1 Konkluzjoni ta' SFT**

92. Jekk SFT li tiġi konkluża sussegwentement tiġi tterminata (inkl. meta tiġi tterminata minħabba falliment ta' saldu), il-kontropartijiet wara li jirrapportawha bit-Tip ta' azzjoni "Ġdid", jenħtieġ li jirrapportawha bit-Tip ta' Azzjoni "Terminazzjoni/Terminazzjoni Bikrija". Jekk l-SFT oriġinali kienet irrapportata bit-Tip ta' Azzjoni "Komponent ta' Pożizzjoni" u sussegwentement tiġi tterminata, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jibagħtux rapport bit-Tip ta' Azzjoni "Terminazzjoni/Terminazzjoni Bikrija" għall-SFT oriġinali, iżda l-kontropartijiet jenħtieġ li jibagħtu rapport bit-Tip ta' Azzjoni "Modifika" għall-pożizzjoni li fiha tkun ġiet inkluża l-SFT oriġinali sabiex din l-SFT titneħħa mill-pożizzjoni.
93. It-Tip ta' azzjoni "Żball" jenħtieġ li jintuża biss biex jiġu kkanċellati t-tranzazzjonijiet li qatt ma nholqu jew li ma jaqgħux fil-kamp ta' applikazzjoni tal-obbligu ta' rapportar skont l-SFTR. Fix-xenarju speċifiku fejn il-kontropartijiet jaqblu li jikkonkludu tranzazzjoni li hija kundizzjonali fuq ir-reġistrazzjoni mas-CCP u s-CCP tirrifjuta dik it-tranzazzjoni, il-kontropartijiet jenħtieġ li jitterminaw l-SFT bit-Tip ta' Azzjoni "Żball" għaliex il-kundizzjoni miftiehma biex it-tranzazzjoni sseħħ ma ġietx issodisfata, għalhekk it-tranzazzjoni qatt ma daħlet fis-seħħ.
94. Barra minn hekk, ta' min jinnota li falliment tas-saldu temporanju, li ma jirriżultax f'terminazzjoni tal-SFT, ma jenħtieġx li jiġi rrapportat.
95. Fil-każ speċifiku ta' self b'marġni, il-konkluzjoni tal-SFT jenħtieġ li tiġi rrapportata meta jkun hemm valur qasir tas-suq jew bilanċ ta' debitu fi flus nett (mill-perspettiva tal-klijent) għall-ewwel darba, u l-kronogramma tal-eżekuzzjoni jenħtieġ li tiġi ppopolata kif xieraq.



#### 4.9.2 Modifika u korrezzjoni ta' SFT

96. Modifika għal SFT 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' kummerċ, jiġifieri mill-mument meta modifika tkun effettiva, din issir rapportabbli. Fejn applikabbli, eż. għat-tibdiliet fuq in-naħa tas-self ta' SLB, dan jenħtieġ li jinftiehem bħala d-data tas-saldu maħsuba.
97. Il-kontropartijiet jenħtieġ li jirrapportaw biss il-modifiki li jkunu seħħew, jiġifieri ma jenħtieġx li jirrapportaw modifiki li jkunu ġew miftiehma iżda li se jsiru effettivi fil-futur. Biex jingħata eżempju, jekk il-kontropartijiet jaqblu li jikklassifikaw mill-ġdid repo f'data futura, il-klassifikazzjoni mill-ġdid jenħtieġ li tiġi rrapportata biss ladarba tintlaħaq id-data miftiehma (id-data effettiva tal-klassifikazzjoni mill-ġdid).
98. B'mod simili għar-rapportar ta' konklużjonijiet, il-fallimenti tas-saldu temporanji mhumiex rapportabbli bħala tali sakemm dawn ma jirriżultawx f'emenda għat-tranzazzjoni, f'liema każ jenħtieġ li tiġi rrapportata kif xieraq bit-tip ta' azzjoni "Modifika". Pereżempju, jekk ritorn parzjali tal-SFT ikun ġie rrapportat bħala modifika u wara jiġi kkanċellat minħabba falliment ta' saldu, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw modifika oħra għal din l-SFT sabiex jregġgħu lura t-tibdiliet li jirriżultaw mir-ritorn parzjali.
99. Fil-każ ta' modifiki retroattivi għal SFT (eż. meta l-kontropartijiet għal SFT b'mod bilaterali jaqblu li jikklassifikaw mill-ġdid tranzazzjoni b'data effettiva fil-passat), il-kontropartijiet ma jkunux mistennija jerġgħu jissottomettu rapporti għall-attivitajiet sussegwenti kollha mid-data effettiva tal-modifika retroattiva. Ta' min jinnota li r-rapport bil-modifika retroattiva jenħtieġ li jiġi rrapportat bid-data tal-avveniment passata korretta (li tirrifletti d-data effettiva tal-modifika). F'dan il-każ, jenħtieġ li t-TRs ma japplikawx id-data mmodifikata għar-rapport dwar l-istat kummerċjali<sup>4</sup>.
100. Fir-rigward tal-korrezzjoni, jenħtieġ li dawn jiġu rrapportati hekk kif tiġi identifikata d-data rrapportata b'mod inkorrett. Mhuwiex meħtieġ li jintbagħat rapport ta' korrezzjoni jekk, wara modifika ta' SFT, kontroparti tkun introduċiet informazzjoni mhux korretta fis-sistemi interni tagħha biss – f'każijiet bħal dawn l-impriza jenħtieġ li tibgħat biss ir-rapport ta' modifika li jkun fih *data* finali u korretta.

#### 4.9.3 Aġġornamenti tal-kollateral

101. L-aġġornament tal-kollateral jenħtieġ li jiġi rrapportat kif relatat mad-data meta jsir effettiv, jiġifieri fid-data tas-saldu mistennija. Madankollu, xi aġġornamenti jistgħu jiġu miftiehma bejn il-kontropartijiet, iżda minħabba raġunijiet attribwibbli lill-kontropartijiet jew lil partijiet terzi, bħal CCPs jew CSDs, jistgħu ma jkunux iffinalizzati. Dan ikun ifisser li rapport ta' aġġornament tal-kollateral partikolari jenħtieġ li jerġa' jiġi sottomess bid-data korretta finali. Jenħtieġ li ma jiġux irrapportati l-fallimenti ta' saldu temporanji li ma għandhomx impatt fuq il-kollateral li ġie miftiehem li jiġi pprovdut.
102. F'xi każijiet oħra, l-entitajiet diġà jkunu qablu dwar xi tibdiliet għall-kollateral iżda jkunux għadhom wettquhom. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw biss l-aġġornamenti tal-

---

<sup>4</sup> Jekk jogħġbok irreferi għat-taqsima 4.8.3 għal aktar dettalji dwar l-impatt tad-data tal-Avveniment fuq it-trattament tar-rapporti mit-TRs.



kollateral li jkunu seħħew, li jfisser li jenħtieġ li ma jirrapportawx il-kollateral bid-data tas-saldu mistennija fil-futur.

103. L-aġġornamenti tal-kollateral huma rapporti ta' ħarsa ġenerali ta' kuljum li jenħtieġ li jirriflettu l-istat tal-kollateral fi tmiem jum partikolari. Jenħtieġ li ma jiġux irrapportati t-tibdiliet tal-istess ġurnata fil-kollateral. Fil-każ speċifiku tat-tranzazzjonijiet tal-istess ġurnata li għalihom il-kollateral jiġi pprovdut għall-istess ġurnata biss u li jsir żero fl-aħħar tal-ġurnata, il-kontropartijiet jenħtieġ li jirrapportaw kollateral żero.
104. Fil-każ ta' tranzazzjonijiet innegożjati f'ċentru u kklirjati minn CCP li huma inklużi fil-pożizzjoni u rrapportati bit-tip ta' azzjoni "Komponent ta' pożizzjoni", l-aġġornamenti tal-kollateral jenħtieġ li jintbagħtu għall-pożizzjoni li fiha kienu inklużi dawn it-tranzazzjonijiet, minflok it-tranzazzjonijiet oriġinali.
105. Fl-aħħar nett, ta' min jinnota li l-aħħar aġġornament tal-kollateral huwa mistenni li jiġi sottomess għall-aħħar jum li fih l-SFT(s) korrispondenti tkun pendenti, u jenħtieġ li jiġi pprezentat sa tmiem il-jum ta' wara. Wara s-sottomissjoni ta' rapport bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni Bikrija" għall-SFT(s) jew wara l-ilħuq tad-data ta' maturità mill-SFT(s) tat-terminu, jenħtieġ li l-aġġornamenti tal-kollateral ma jintbagħtux għal dik l-SFT(s) (ħlief għar-rapporti tardivi nieqsa).
106. Fil-każ speċifiku ta' self b'marġni, l-aġġornamenti tal-kollateral jenħtieġ li jintbagħtu biss fejn ikun hemm valur qasir tas-suq jew bilanċ ta' debitu nett (mill-perspettiva tal-klijent). Fil-każijiet li fihom is-self b'marġni jkun għadu ma ġie prelevat mill-klijent, il-kontropartijiet jenħtieġ li la jirrapportaw tranzazzjoni SFT u lanqas il-kollateral korrispondenti. Jista' jkun hemm ukoll xenarji fejn is-self b'marġni jkun ġie prelevat mill-klijent (b'hekk, ikunu ġew irrapportati t-tranzazzjoni ta' self b'marġni u l-kollateral korrispondenti), u sussegwentement, is-self b'marġni jiġi żero. F'dawn il-każijiet, jekk il-kontropartijiet ma jiddeċidux li jagħlqu l-SFT, jenħtieġ li jissottomettu rapport tal-kollateral "żero" għall-ewwel jum li fih il-valur tas-self b'marġni jkun żero. Ladarba s-self b'marġni jerġa' jintuża mill-klijent, il-valuri attwali tal-kollateral jenħtieġ li jiġu rrapportati għal din l-SFT.

#### 4.9.4 Aġġornamenti tal-valwazzjoni, tal-marġni u tal-użu mill-ġdid

107. Fil-każ ta' aġġornamenti tal-valutazzjoni, jenħtieġ li l-kontropartijiet jibagħtu valutazzjonijiet ta' kuljum sa tmiem il-jum ta' xogħol wara d-data tal-valwazzjoni u billi jippopolaw din id-data fil-kamp "Data tal-avveniment".
108. L-aġġornamenti tal-marġni jenħtieġ li jiġu rrapportati meta jsiru effettivi, jiġifieri fid-data tas-saldu mistennija, mingħajr ma jiġu kkunsidrati fallimenti temporanji ta' saldu.
109. Fil-każ speċifiku ta' marġini mħallsa minn qabel lil CCP ta' portafoll ta' negozjar ikklirjat, jenħtieġ li dawn jiġu rrapportati f'T+1 tal-ewwel SFT applikabbli fil-portafoll relatat (marbuta b'kodiċi tal-portafoll), minflok fil-jum ta' wara d-data li fiha jkunu ġew ipprezentati.
110. Fir-rigward tar-rapportar tal-użu mill-ġdid, dan huwa mmexxi mis-saldu, li jfisser li jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw biss il-valur tal-kollateral użat mill-ġdid saldat fl-aħħar ta' data partikolari. Din id-data tas-saldu jenħtieġ li tiġi rrapportata bħala Data ta' avveniment fir-rapporti tal-użu mill-ġdid, li jenħtieġ li jiġu pprezentati sa tmiem il-jum ta' wara (jiġifieri d-data tas-saldu + 1). Ir-rapporti dwar l-użu mill-ġdid huma rapporti ta' ħarsa ġenerali tal-

EOD, jiġifieri dawn jenħtieġ li jirrapprezentaw il-kollateral użat mill-ġdid fl-aħħar tal-ġurnata, minflok tibdil mill-valuri rrapportati preċedentement (“rapport delta”).

#### 4.9.5 Terminazzjoni ta' SFT

111. Jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jibagħtux rapport bit-Tip ta' Azzjoni “Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija” meta SFT b'terminu fiss tilhaq id-data ta' maturità tagħha u, għalhekk, ma tkunx għadha pendenti.
112. Jekk il-kontropartijiet jaqblu li jitterminaw SFT b'terminu fiss qabel id-data ta' maturità jew li jitterminaw l-SFT b'terminu miftuħ, jenħtieġ li dawn jew:
  - a. Jipprezentaw rapport bit-Tip ta' Azzjoni “Terminazzjoni/terminazzjoni bikrija” fejn is-saldu mistenni tat-terminazzjoni jkun għall-istess jum tal-avviż ta' terminazzjoni, jew
  - b. Jipprezentaw rapport bit-Tip ta' Azzjoni “Modifika” fejn is-saldu mistenni tat-terminazzjoni jkun il-jum ta' wara jew aktar tard. F'dan il-każ, il-kontropartijiet jenħtieġ li jimmodifikaw id-*data* tal-maturità kif xieraq.
113. Minhabba li skont il-loġika ta' rapportar prevista fl-SFTR RTS/ITS (u b'mod konsistenti mal-loġika kurrenti ta' rapportar skont l-EMIR), ma hemm l-ebda possibbiltà li “tinfetaħ mill-ġdid” tranżazzjoni ladarba tiġi tterminata, il-kontropartijiet jenħtieġ li ma jirrapportawx it-terminazzjoni jekk ma ssejtnx minhabba falliment ta' saldu.
114. Fil-prattika, jekk fil-jum ta' wara d-data miftiehma ta' terminazzjoni bikrija, il-kontropartijiet isiru konxji li t-terminazzjoni ma tkunx ġiet saldata fid-data tas-saldu mistennija, jenħtieġ li dawn ma jibagħtux ir-rapport bit-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija” sakemm tiġi saldata t-terminazzjoni. Jekk it-terminazzjoni tiġi kkanċellata minhabba l-falliment tas-saldu, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jibagħtux ir-rapport bit-Tip ta' Azzjoni “Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija” peress li l-SFT tibqa' pendenti.
115. B'mod simili, fil-każ ta' SFTs li jkunu waslu viċin id-data ta' maturità tagħhom (jew id-Data originali tal-maturità miftiehma kuntrattwalment (Kamp 2.14) jew id-Data ta' maturità li tiġi emendata biex tiġi rrapportata terminazzjoni bikrija li tkun ġiet miftiehma minn qabel), jekk fil-jum ta' wara d-data ta' maturità l-kontropartijiet isiru konxji li l-komponent ta' wara tal-SFT ma jkunx ġie saldat, jenħtieġ li jibagħtu rapport ta' modifika biex tiġi emendata d-data ta' maturità għall-jum li jmiss jew għal jum futur ieħor li fih mistennija tiġi saldata. Ta' min jinnota li tali emenda tad-Data ta' maturità tkun possibbli biss sal-jum ta' wara d-data ta' maturità, peress li minn din id-data l-SFT ma tibqax pendenti u ma jkunx possibbli li “tinfetaħ mill-ġdid”. Meta r-ritorn jiġi saldat b'suċċess, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jibagħtux rapporti addizzjonali, peress li l-SFT tiġi ttrattata bħala mhux pendenti mill-jum ta' wara d-Data ta' maturità.

#### 4.9.6 Farsa ġenerali lejn l-iskedi ta' żmien tar-rapportar għal kull tip ta' rapport u tip ta' azzjoni

116. It-Tabella 5 tispeċifika dak li jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala “Data ta' avveniment” għal kull tip ta' rapport u tip ta' azzjoni. Id-data tal-avveniment, skont id-definizzjoni, tindika wkoll x'inhu skattatur għar-rapportar, eż. id-data tas-saldu mistennija fil-każ ta' aġġornamenti

tal-kollateral jew id-data ta' valwazzjoni fil-każ ta' aġġornamenti ta' valutazzjoni. Jenħtieġ li r-rapporti attwali jiġu ppreżentati sa tmiem il-jum ta' xogħol wara d-data tal-avveniment.

Tabella 5 – Data tal-avveniment		
Table	Action type	Data tal-avveniment
1&2	NEWT	Data tal-konklużjoni tal-kuntratt (“data tan-negozju”)
1&2	MODI	Data effettiva tal-modifika jew, fejn applikabbli, id-data tas-saldu mistennija
1&2	CORR	Id-data minn meta jenħtieġ li tapplika l-korrezzjoni (tipikament id-data li għaliha giet irrapportata <i>data</i> mhux korretta preċedenti)
1&2	ETRM	Data tas-saldu mistennija tat-terminazzjoni
1&2	EROR	MA
1&2	COLU	Data tas-saldu mistennija
1&2	VALU	Data tal-valwazzjoni
3	NEWT	Data tas-saldu mistennija
3	MARU	Data tas-saldu mistennija
3	CORR	Id-data minn meta jenħtieġ li tapplika l-korrezzjoni (tipikament id-data li għaliha giet irrapportata <i>data</i> mhux korretta preċedenti)
3	EROR	MA
4	NEWT	Data tas-saldu attwali
4	REUU	Data tas-saldu attwali
4	CORR	Id-data minn meta jenħtieġ li tapplika l-korrezzjoni (tipikament id-data li għaliha giet irrapportata <i>data</i> mhux korretta preċedenti)
4	EROR	MA

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

117. It-Tabella 6 turi l-immappjar bejn l-avvenimenti tan-negozju li jsejtnu tul iċ-ċiklu tal-ħajja ta' SFT u t-tipi ta' azzjoni li huma ddefiniti fit-TS dwar ir-rapportar.
118. Meta l-kontropartijiet jaqblu li jterminaw kmieni u jissostitwixxu SFT, dan jenħtieġ li jiġi rrapportat kif xieraq. F'każijiet bħal dawn, jenħtieġ li l-ewwel il-kontropartijiet itemmu l-SFT oriġinali (billi jibagħtu jew “Terminazzjoni/terminazzjoni bikrija” jew “Modifika” b'data ta' maturità emendata) u mbagħad jippreżentaw ir-rapport tat-tranzazzjoni l-ġdida (bit-tip ta' azzjoni “Ġdid”).
119. Bl-istess mod, biex tiġi ssimplifikata t-tabella, l-avvenimenti kollha li jirriżultaw f'terminazzjoni ta' SFT huma mmappjati skont it-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni/terminazzjoni bikrija”, ħlief għall-avveniment 44 li jitratta speċifikament ir-rapportar tat-terminazzjonijiet. Madankollu, huwa rikonoxxut li fejn it-terminazzjoni ta' tranzazzjoni tiġi miftiehma għal data oħra fil-futur, ġeneralment jenħtieġ li tiġi rrapportata bħala modifika tad-data ta' maturità (bit-tip ta' azzjoni “Modifika”), filwaqt li t-terminazzjoni fl-istess jum jenħtieġ li tiġi rrapportata bit-tip ta' azzjoni “Terminazzjoni/terminazzjoni bikrija”.

120. L-ebda tip ta' azzjoni addizzjonali ma jista' jiġi inkluż fit-TS dwar ir-rapportar u, għalhekk, jenħtieġ li dawk inklużi fit-TS jintużaw mill-kontropartijiet meta jirrapportaw I-SFTs u l-avvenimenti tan-negozju rilevanti li jappartjenu għalihom.

121. L-avvenimenti taċ-ċiklu tal-ħajja tan-negozju għat-tipi differenti ta' SFTs jenħtieġ li jiġu rrapportati bit-Tipi ta' Azzjoni li ġejjin (Kamp 2.98) u l-Livelli rilevanti (Kamp 2.99)<sup>5</sup>.

**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
1	Backloading	All	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN / PSTN	
2	Conclusion	All	Table 1 and Table 2	NEW T or POS C	TCTN / PSTN	Dan jinkludi tranżazzjoni fi blokko/fi gruppi/bl-ingrossa minn aġent għall-allokazzjoni lill-klijenti. Dan jinkludi wkoll kwalunkwe tranżazzjoni rapportabli li tiġi konkluzja għall-fini tas-saldu (awtokollateralizzazzjoni minn (I)CSD, minn faċilitajiet ta' kreditu oħrajn, mill-awtoself tal-istess ġurnata ta' titoli minn (I)CSD). Is-saldu tal-komponent tal-ftuħ, inkluż saldu tardiv li ma jirriżultax f'terminazzjoni jew f'imposti oħra għall-SFT, jenħtieġ li <b>ma jiġix</b> irrapportat b'mod separat. Fil-każ ta' self b'marġni, jenħtieġ li l-konkluzjoni tiġi rrapportata meta l-kreditu jiġi estiż għall-ewwel darba.
3	Roll-over into new identical transaction	REPO	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN	
4	Extension	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	Dan jinkludi, eż., l-estensjoni ta' repo estendibbli, ta' ftehim ad hoc biex tinbidel id-data ta' riakkwist ta' repo b'terminu fiss jew ta' ftehim biex id-data tar-riakkwist tiġi differita bħala parti mill-proċess ta' ġestjoni tal-fallimenti
5	Automatic change of purchase and repurchase dates of an evergreen SFT at the end of each business day until termination or maturity	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	
6	Cancellation of disputed transaction (after external reporting)	All	Table 1 and Table 2	ERO R	-	

<sup>5</sup> Il-lista ta' avvenimenti tan-negozju mhijiex eżawrjenti

<sup>6</sup> Ir-referenzi huma għat-tabelli tal-RTS u tal-ITS dwar ir-rapportar

**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
7	New allocation of the SFTs	All	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN	Eż. żvelar ta' kapitali sottostanti minn aġent lil parti oħra f'repo ta' aġenzija "fi grupp"
8	Full reallocation with a new UTI	All	Table 1 and Table 2	ETR M + NEW T	TCTN	Dan jinkludi wkoll ix-xenarju li fih ir-riallokazzjoni sseħħ qabel is-saldu tal-komponent tal-ftuħ tat-tranzazzjoni oriġinali.
9	Full reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	ETR M + MOD I	TCTN	Dan jinkludi wkoll ix-xenarju li fih ir-riallokazzjoni sseħħ qabel is-saldu tal-komponent tal-ftuħ tat-tranzazzjoni oriġinali.
10	Partial reallocation to a new UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + NEW T	TCTN	Dan jinkludi wkoll ix-xenarju li fih ir-riallokazzjoni sseħħ qabel is-saldu tal-komponent tal-ftuħ tat-tranzazzjoni oriġinali.
11	Partial reallocation to an existing UTI	All	Table 1 and Table 2	MOD I + MOD I	TCTN	Dan jinkludi wkoll ix-xenarju li fih ir-riallokazzjoni sseħħ qabel is-saldu tal-komponent tal-ftuħ tat-tranzazzjoni oriġinali.
12	Increase or reduce size of a repo by modifying the terms of the contract (same UTI, no settlement instructions issued)	REPO	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	
13	Agreement to accept the partial delivery of the collateral as final implemented by a change in contractual terms	REPO	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	
14	Partial termination	REPO, BSB, ML	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	
15	Partial return	All	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	Is-saldu tar-ritorn parzjali, inkluż saldu tardiv li ma jirriżultax f'kancellazzjoni tar-ritorn parzjali, jenħtieġ li ma jiġix irrapportat b'mod separat.
16	Cancellation or failure of the partial return	SBL	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	Jenħtieġ li saldu tardiv li ma jirriżultax f'kancellazzjoni tar-ritorn parzjali ma jiġix irrapportat
17	Re-rating (fixed rate, spread or rebate rate)	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	
18	Agreed cancellation of the re-rate, hence reverting to the previous rate	REPO, BSB, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	Jekk il-klassifikazzjoni mill-ġdid ma ġietx miftiehma iżda giet irrapportata b'mod unilaterali bi żball, jenħtieġ li t-tibdil fir-rata preċedenti jiġi rrapportat b'"CORR"
19	Change in floating repo rate	REPO	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	

**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
20	Scheduled change in rate on floating-rate collateral or index on index-linked collateral in a BSB	BSB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	Dan l-avveniment ikun jirriżulta fir-rapport tal-modifika tal-prezz tar-riakkwist.
21	Events impacting the collateral value	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	COL U	-	Eż. Pagament ta' introjtu ta' kollateral (repo, BSB), pagament manifatturat (repo, BSB), tibdil skedat fir-rata fuq kollateral b'rata varjabbli jew indici fuq kollateral indiciżat fi kwalunkwe tip ta' repo
22	Cash mark	SBL	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	
23	Fee mark	SBL	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	
24	Valuation of securities on loan	SLB	Table 1 and Table 2	VAL U	-	
25	Flat margin loan and/or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
26	Change in outstanding margin loan or short market value	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
27	Change of base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	MOD I	-	
28	Additional base currency used for margin loan	ML	Table 1 and Table 2	NEW T	-	Hemm munita bażi waħda biss għal kull self b'marġni, u għalhekk munita bażi addizzjonali jenftieg li tiġi rrapportata bħala self b'marġini ġdid b'UTI ġdid
29	Valuation of securities used as collateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	
30	First allocation of collateral on the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	NEW T or COL U	TCTN	Tip ta' azzjoni NEWT jintuża meta d-dettalji tal-kollateral jiġu rrapportati ma' dettalji oħra ta' SFT fir-rapport ta' tranżazzjoni ġdida Dan jista' jkun pereżempju xenarju ta' allokkazzjoni ta' kollateral mill-bejjiegħ għal repo GC ġdid jew l-ewwel allokkazzjoni ta' kollateral minn aġent tripartitiku fil-jum tan-negozju
31	First allocation of collateral after the day of trade	REPO	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN	Dan jista' jkun pereżempju xenarju ta' allokkazzjoni ta' kollateral mill-bejjiegħ għal repo GC ġdid jew l-ewwel allokkazzjoni ta' kollateral minn aġent tripartitiku wara l-jum tan-negozju

**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
32	Substitution of Collateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	Dan jinkludi, eż., sostituzzjoni temporanja ta' titoli bi flus (tipikament permezz ta' agent tripartitiku) fil-każ ta' nuqqas ta' kollateral eligibbli fil-kont tal-bejjiegh, sostituzzjoni ta' kollateral temporanju fi flus b'kollateral f'titoli, kollateralizzazzjoni temporanja bi flus għad-dewmien bi skambju ma' titoli b'reazzjoni għal eżekuzzjoni ta' margni ta' varjazzjoni skont il-GMRA 6(h). Dan jinkludi wkoll kwalunkwe tibdil fil-kollateral minħabba l-avvenimenti korporattivi.
33	Change in collateral quality	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	
34	Change in cash collateral amount or currency	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COL U	-	
35	Buy-in where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	
36	Cash compensation where required by regulation (e.g. CSDR) or market convention (not under GMRA)	All	Table 1 and Table 2	COL U	-	
37	Default of the collateral issuer	All	ALL	COL U or ETR M	TCTN / PSTN	ETRM jenhtieg li jiġi rrapportat biss meta SFT tiġi tterminata wara l-inadempjenza tal-emittent tal-kollateral. Inkella, is-sostituzzjoni tal-kollateral jenhtieg li tiġi rrapportata b'COLU
38	Variation margining	REPO, SLB, BSB	Table 1 and Table 2	COL U	-	Dan huwa rapport separat dwar il-COLU għall-iskopertura netta
39	Change in haircut or margins	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN / PSTN	
40	Clearing off-venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN / PSTN	Dan jinkludi tranżazzjonijiet OTC ikklirjati fl-istess jum jew wara
41	Post-trade clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	ETRM + NEW T	TCTN / PSTN	Dan jinkludi tranżazzjonijiet eżegwiti f'centru tan-negozjar li jkunu ġew ikklirjati wara l-jum tan-negozju
42	Same-day clearing of a transaction executed on a trading venue	All	Table 1 and Table 2	NEW T	TCTN / PSTN	Dan jinkludi tranżazzjonijiet eżegwiti f'centru tan-negozjar ikklirjati permezz ta' mudell ta' offerta miftuħa u ta' novazzjoni tal-istess jum



**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
43	CCP rejects transaction which is conditional upon registration with the CCP	All	Table 1 and Table 2	ERROR	-	
44	Termination of an open SFT or termination of a term repo (by agreement or unilaterally)	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I or ETR M	TCTN	Jenħtiegħ li l-ETRM jiġi rrapportat għat-terminazzjoni fl-istess ġurnata, filwaqt li l-MOD I jenħtiegħ li jintuża biex tiġi rrapportata t-terminazzjoni f'data futura (billi tiġi emendata d-data ta' maturità)
45	Termination of an evergreen or puttable SFT	REPO, SLB	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN	Dan jinkludi l-eliminazzjoni tal-opzjonalità tat-terminazzjoni
46	Maturity/Expiration	All	Table 1 and Table 2	no report	-	Jenħtiegħ li l-falliment tas-saldu temporanju tal-SFT li tiskadi ma jiġix irrapportat separatament
47	Full return of a term SLB prior to the maturity date or of an open term SLB	SBL	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Is-saldu tar-ritorn sħiħ, inkluż saldu tardiv li ma jirriżultax f'kancellazzjoni tar-ritorn sħiħ, jenħtiegħ li ma jiġix irrapportat b'mod separat.
48	Cancellation or failure of the full return	SBL	Table 1 and Table 2	no report or NEW T	TCTN	Jenħtiegħ li r-ritorn sħiħ ma jiġix irrapportat jekk ma jsaldax, u, għalhekk, jekk ir-ritorn sħiħ jiġi kkanċellat, ma jkun mistenni l-ebda rapport addizzjonali. Madankollu, jekk ir-ritorn sħiħ ikun ġie rrapportat bħala ETRM u sussegwentement ir-ritorn kollu jkun ikkanċellat, jenħtiegħ li t-tranzazzjoni tiġi rrapportata mill-ġdid bit-tip ta' azzjoni NEW T u b'UTI ġdid
49	Closure of an SFT due to counterparty default	All	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Dan jinkludi, eż., it-tqegħid ta' kontroparti f'inadempjenza dment li din l-għażla ta' inadempjenza tkun ġiet miftiehma skont il-GMRA 10(a)(ii)
50	Termination of transaction under specific GMRA provisions	REPO, BSB	Table 1 and Table 2	ETRM	-	Dan jinkludi: It-terminazzjoni tat-tranzazzjoni skont id-dispożizzjoni 10(g) 2000 jew id-dispożizzjoni 10(h) tal-GMRA 2011 "Mini close-out" taħt il-GMRA 2000 10(h) jew il-GMRA 2011 10(i) Repricing jew Adjustment taħt il-GMRA 2000 4(i)-(k) jew GMRA 2011 4(j)-(l)
51	Terminating the relationship between prime broker and the client	ML	Table 1 and Table 2	ETRM	-	
52	Amend trade - bilateral	All	Table 1 and Table 2	MOD I	TCTN / PSTN	Il-kontropartijiet jaqblu li jemendaw attribut ta' tranzazzjoni. Dan huwa avveniment li jkopri kolli għal kwalunkwe modifika mhux elenkata b'mod separat
53	Amend trade - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Kontroparti waħda tikkoreġi attribut ta' tranzazzjoni



**Tabella6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
54	Amend collateral - bilateral	All	Table 1 and Table 2	COL U	TCTN / PSTN	Il-kontropartijiet jaqblu li jemendaw attribut tal-kollateral. Dan huwa avveniment li jkopri kolloxx għal kwalunkwe modifika mhux elenkata b'mod separat
55	Amend collateral - unilateral	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Kontroparti waħda tikkoreġi attribut ta' kollateral
56	Lifecycle event (e.g. change in size or re-rating of open repo) incorrectly reported	All	Table 1 and Table 2	COR R	TCTN / PSTN	Mhuwiex possibbli li jiġu kkoreġuti terminazzjoni bikrija jew żball irrapportati hażin. Ladarba jintbagħat rapport b'dawn it-tipi ta' azzjoni, ma jkun hemm l-ebda mod kif it-tranzazzjoni tingieb lura għal status pendenti, u għalhekk ikun meħtieġ li t-tranzazzjoni terġa' tiġi rrapportata mill-ġdid b'tip ta' azzjoni NEWT u UTI ġdid.
57	Transaction not executed or out of scope of SFTR but reported to TR by mistake	All	Table 1 and Table 2	ERO R	-	
58	Initial posting of margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	NEW T	-	
59	Update of the initial margin posted at the CCP	All	Table 3	MAR U	-	
60	Posting variation margin to a CCP for cleared SFTs	All	Table 3	MAR U	-	
61	Correction of a previous submitted margin report	All	Table 3	COR R	-	
62	Cancellation of a wrongly submitted margin report	All	Table 3	ERO R	-	
63	First report of reuse of collateral or reinvestment of cash collateral	All	Table 4	NEW T	-	
64	Change in the securities reused or update of the estimated reuse or value of reused collateral	All	Table 4	REU U	-	
65	Change in cash collateral reinvestment type, amount or currency	SLB	Table 4	REU U	-	
66	Correction of a previously submitted collateral reuse	All	Table 4	COR R	-	

**Tabella 6 - Immappjar ta' avvenimenti tan-negozju għal tipi u għal livelli ta' azzjoni**

New Event #	Business / Trade Event	Type of SFT	Applicable XML Message <sup>6</sup>	Action Type	Level	Kummenti/eżempji
	report with incorrect data					
67	Cancellation of a wrongly submitted collateral reuse report (e.g. for an entity not subject to the reporting obligation)	All	Table 4	ERROR	-	

#### 4.11 Identifikazzjoni ta' parteċipant tas-CSD

122. Għajr għal każijiet fejn jiġi rrapportat self b'marġni, jew meta tranżazzjoni tinvolvi komoditajiet, jenħtieġ li l-kontropartijiet dejjem jippopolaw il-kamp tal-parteeċipant tad-Depożitorju Ċentrali tat-Titoli (CSD) jew tal-parteeċipant indirett. Il-qasam jenħtieġ li jiġi rrapportat anki jekk l-SFT tiġi saldata barra minn CSD. L-ESMA tistenna li l-kontroparti li tirrapporta jenħtieġ li tirrapporta dan il-kamp billi tuża l-loġika li ġejja:

- Tirrapporta l-LEI tagħha stess jekk tkun qed issalda direttament fi kwalunkwe CSD, jiġifieri tkun parteċipant ta' CSD;
- Tirrapporta l-LEI tagħha stess jekk qed issalda titoli fi kwalunkwe wieħed miż-żewġ ICSDs anke fejn l-ICSD ma jkunx is-CSD emittent, jiġifieri l-kontroparti tkun parteċipant tal-ICSD;
- Tirrapporta l-LEI tal-bank kustodju tagħha irrispettivament minn jekk il-kustodju jkunx qed juża xi sottokustodju jew le. Dan jinkludi xenarji li fih kontroparti tuża Agent Sellief.

123. Jenħtieġ li l-kontroparti ma tirrapportax l-LEI tas-CSD li fih tkun parteċipant dirett jew indirett fil-kamp "Parteċipant tas-CSD".

#### 4.12 Determinazzjoni tan-naħa tal-kontroparti

##### 4.12.1 Każ ġenerali

124. Fil-każ ta' repos jew ta' BSBs, ix-xerrej ikun ir-riċevitur ta' kollateral, filwaqt li l-bejjiegħ ikun il-fornitur tal-kollateral.

125. Fil-każ ta' SLB jew ta' SFTs li jinvolvu komoditajiet, is-sellief ikun ir-riċevitur ta' kollateral, filwaqt li l-mutwatarju jkun il-fornitur tal-kollateral.

126. Fil-każ ta' self b'marġni, is-sellief ikun ir-riċevitur ta' kollateral, filwaqt li l-mutwatarju jkun il-fornitur ta' kollateral.

#### 4.12.2 SFTs ikklirjati minn CCP

127. Fil-każ ta' SFTs ikklirjati minn CCP, is-CCP tqiegħed lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet għall-SFT. Għalhekk, tkun xerrej għall-bejjiegħ, mutwatarju għas-sellief, bejjiegħ għax-xerrej u s-sellief għall-mutwatarju.

#### 4.12.3 Rapportar ta' għoti/teħid b'self mhux garantit ta' titoli

128. Fil-każ ta' għoti u teħid b'self mhux garantit ta' titoli, il-kontroparti li tislef it-titoli jenħtieġ li tirrapporta lilha nnifisha bħala r-riċevitur ta' kollateral, u l-kontroparti li tissellef it-titoli jenħtieġ li tirrapporta lilha nnifisha fil-Kamp 1.9 bħala l-fornitur ta' kollateral.

#### 4.12.4 Ir-rapportar tan-naħa tal-kontroparti fil-każ ta' kollateralizzazzjoni tal-iskopertura netta

129. Fil-każ ta' kollateralizzazzjoni tal-iskopertura netta, jenħtieġ li l-kontropartijiet ma jirrapportawx il-Kamp "Min-naħa tal-kontroparti" għall-kollateral li jintuża bħala proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni. Madankollu, wara d-determinazzjoni ta' jekk humiex fornituri netti ta' kollateral jew riċevituri netti ta' kollateral, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw il-kollateral li jappartjeni għall-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni kif spjegat fit-taqsimha 5.4.7.

### 4.13 Kampijiet tal-prezz u tal-valur

#### 4.13.1 Twaqqit tal-valwazzjonijiet

130. Meta SFT tiġi kklirjata, l-informazzjoni relatata mal-valwazzjonijiet miksuba mis-CCP jenħtieġ li tintuża għar-rapportar tal-SFTR.

131. Il-valur tas-suq tat-titoli jenħtieġ li jkun dak f'għeluq in-negozju ta' kull jum ta' negozju, u jenħtieġ li jiġi rrapportat mhux aktar tard minn T+1, filwaqt li jirrifletti l-valutazzjoni użata għal skopijiet ta' ġestjoni tal-kollateral, eż. għall-kalkolu tal-margni ta' varjazzjoni ta' kuljum.

132. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw il-valur tas-suq tal-SFTs tagħhom billi jużaw il-prezzijiet tas-suq u r-rati FX li daww il-kontropartijiet ikunu użaw matul dak il-jum ta' negozju għal skopijiet ta' ġestjoni tal-iskoperturi. Għal tranżazzjonijiet ta' għoti b'self ta' titoli, dan ġeneralment ikun ifisser li l-valuri tas-suq irrapportati f'għeluq in-negozju fi kwalunkwe jum partikolari jkunu l-prezzijiet tal-għeluq tat-titoli tal-jum ta' negozju preċedenti u rrapportati mhux aktar tard minn T+1.

133. Jekk jiġu pprovduti valwazzjonijiet għal żewġ granet differenti, il-kontropartijiet jenħtieġ li jippopolaw il-Kamp 2.3 "Data tal-Avveniment" kif xieraq għal kull jum differenti.

#### 4.13.2 Metodu ta' kalkolu għall-valutazzjonijiet

134. Meta jirrapportaw skont l-SFTR, jenħtieġ li l-kontropartijiet jużaw il-valur li jużaw għall-finijiet tal-ġestjoni tal-kollateral u tal-ġestjoni tal-iskoperturi.

135. Meta ma jkun hemm l-ebda valur tas-suq disponibbli, l-SFTR ma jippreskrivi l-ebda metodu speċifiku għall-kalkolu ta' dawn il-valwazzjonijiet. Madankollu, id-*data* rrapportata taħt il-Kampijiet 2.57 u 2.88 hija *data* rikonċiljabbli u, għalhekk, jenħtieġ li l-kontropartijiet jaqblu u jirrapportaw valuri li huma fil-limiti aċċettati tad-differenza ta' tolleranza, kif spjegat fid-dettall fl-Anness għall-RTS dwar il-ġbir tad-*data*.
136. Il-valur tas-suq tat-titoli jenħtieġ li jiġi rrapportat f'għeluq in-negozju ta' kull jum ta' xogħol, filwaqt li jkun jirrifletti l-valwazzjoni użata għal skopijiet ta' ġestjoni tal-kollateral, eż. għall-kalkolu tal-marġni ta' varjazzjoni ta' kuljum.
137. Fil-każ li prezz tas-suq għat-titoli li jkunu qed jiġu vvalutati ma jkunx disponibbli, il-kontroparti li tirrapporta jenħtieġ li tuża l-prezz tas-suq l-aktar reċenti disponibbli bħala għażla ta' riżerva.
138. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jużaw, kif xieraq, it-tags tal-XML tal-munita għall-kampijiet kollha tal-prezzijiet biex jidentifikaw b'mod korrett il-kampijiet tal-valur u tal-ammont rilevanti, u aktar importanti minn hekk, meta jkunu f'munita differenti. Jekk jogħġbok irreferi wkoll għall-eżempju fit-Taqsima 5.2.1.8.
139. Meta kontroparti jkollha tuża rata FX biex tissottometti valwazzjoni preċiża, jenħtieġ li tintuża r-rata rilevanti tal-BĊE. Fil-każ li rata FX tal-BĊE ma tkunx teżisti għall-konverżjoni, jenħtieġ li l-kontropartijiet jaqblu bejniethom dwar liema rata FX għandha tintuża għal skopijiet ta' valwazzjoni u rapportar.

#### 4.14 Rapportar tas-CFI għal titolu użat bħala kollateral

140. Meta titolu jintuża bħala kollateral, jenħtieġ li l-kodiċi tas-CFI ta' dak it-titolu jiġi rrapportat fil-kampijiet 42 u 79 tat-tabella fuq id-*data* dwar is-Self u l-Kollateral. Dan il-kamp ma japplikax għall-komoditajiet.
141. Jenħtieġ li l-kontropartijiet dejjem jużaw sorsi uffiċjali għas-CFI. Għal dan l-għan, jenħtieġ li tintuża d-*data* maħruġa mill-Aġenzija Nazzjonali ta' Numerazzjoni (NNA) rilevanti. Informazzjoni ulterjuri hija pprovduta mill-ANNA f'dan il-link <http://www.anna-web.org/standards/about-identification-standards/>, jew mill-NNA rilevanti tat-titolu.
142. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw CFIs validi biss. Jekk is-CFI ma jkunx jeżisti fis-sorsi uffiċjali, allura jenħtieġ li jkun hemm ftehim bejn il-kontropartijiet, minhabba li s-CFI huwa kamp rikonċiljabbli.

#### 4.15 Posponiment lejn tmiem il-perjodu

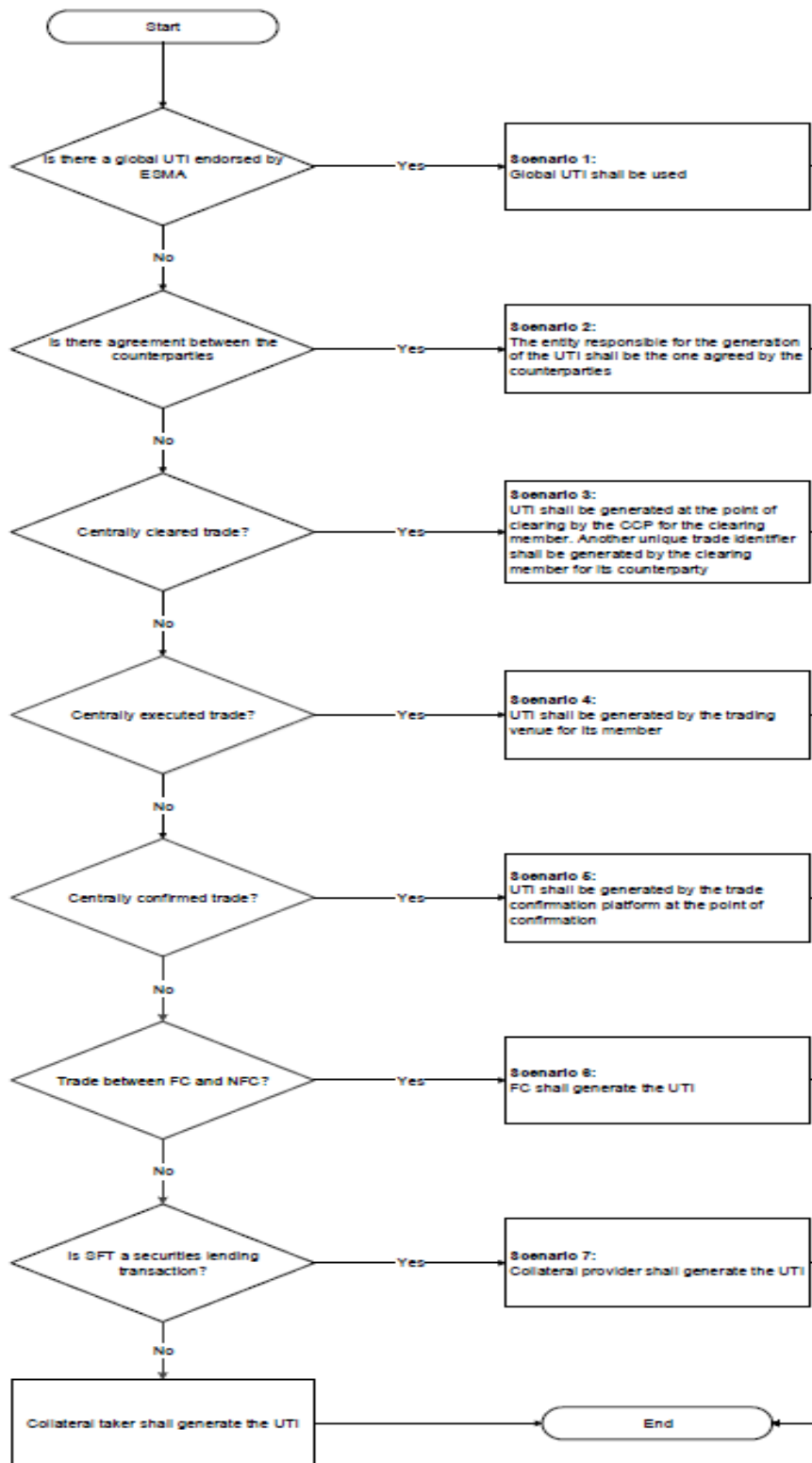
143. Il-kontropartijiet li jiddeċiedu li jirrapportaw dwar RSD ta' qabel jentieg li jirrapportaw dettalji kompluti u preċiżi tat-tranzazzjonijiet rilevanti posposti lejn tmiem il-perjodu, inkluż l-aġġornament ta' kuljum tal-kollateral bit-tip ta' azzjoni "COLU". Jekk jirrapportaw porzjon tal-SFTs tagħhom, jenħtieġ li jirrapportaw dettalji kompluti u preċiżi tad-*data* dwar il-marġni u l-użu mill-ġdid fit-Tabelli 3 u 4 tal-Anness għat-TS dwar ir-rapportar.
144. F'każ li ż-żewġ kontropartijiet ikunu koperti mill-RSD rilevanti, biex jitnaqqsu l-waqqiet fir-rikonċiljazzjoni, jenħtieġ li dawn jaqblu fuq liema jum huma jipposponu l-SFTs lejn tmiem il-perjodu. Fi kwalunkwe każ, ir-rapportar tat-tranzazzjonijiet ta' posponiment lejn tmiem il-

perjodu jenħtieġ li jsir sa RSD+190. Jekk kontroparti tar-rapportar li għaliha l-RSD tkun għadha ma bdiex tapplika tiddeċiedi li tirrapporta tranżazzjonijiet ta' posponiment lejn tmiem il-perjodu, jenħtieġ li tiżgura li kull SFT tkun irrapportata skont il-paragrafu 146.

145. Jekk il-kontropartijiet jiddeċiedu li jagħmlu dan, ir-rapportar sħiħ ta' SFTs posposti lejn tmiem il-perjodu, jiġifieri r-rapportar tal-SFTs kollha li jkunu miftuħa f'punt partikolari ta' żmien wara l-ewwel RSD qabel l-iskadenza msemmija qabel, jibqa' possibbli fuq bażi volontarja wkoll.
146. It-tranżazzjoni posposta lejn tmiem il-perjodu jenħtieġ li tiġi rrapportata bit-tip ta' azzjoni (Kamp 2.98) ippopolat b'"NEWT". Il-"Kronogramma ta' eżekuzzjoni" (Kamp 2.12) jenħtieġ li tiġi ppopolata bil-kronogramma ta' eżekuzzjoni oriġinali. Id-"Data tal-valur (data tal-bidu)" (Kamp 2.13) jenħtieġ li tiġi ppopolata bid-data tal-valur oriġinali, sakemm ma tkunx ġiet emendata minħabba kwistjonijiet ta' saldu fir-rigward tal-SFT. Il-bqija tal-kampijiet tad-*data* jenħtieġ li jkun fihom l-istat fiż-żmien tar-rapportar. Jenħtieġ li l-avvenimenti preċedenti taċ-ċiklu tal-ħajja ma jiġux irrapportati b'mod separat.

#### **4.16 Ġenerazzjoni u struttura tal-UTI**

147. Il-flowchart ta' hawn taħt turi l-proċess biex jiġi ġġenerat UTI.



148. Fil-każ ta' SFTs ikklijrjati, kull waħda mill-SFTs bejn is-CCP u l-membri tal-ikklijrjar tagħha, u bejn il-membri tal-ikklijrjar u l-klijenti tagħhom, jenħtieġ li tiġi rrapportata b'UTIs differenti.
149. Ta' min jinnota li l-ftehim dwar il-UTI bejn il-kontropartijiet fil-prattika huwa l-għażla ta' riżerva skont il-qafas ipprovdut fl-istandards tekniċi, peress li ħafna mill-entitajiet

jiddependu fuq il-kaskata għall-ġenerazzjoni tal-UTI. Madankollu, il-partijiet jista' jkollhom ftehim bħal dan, f'liema każ huma jenħtieġu li jirrispettawh fil-każijiet kollha li jkunu koperti mill-ftehim.

150. Fil-każ ta' SFTs b'terminu miftuħ, jenħtieġ li l-kontropartijiet jżommu l-UTI iġġenerat inizjalment għal dik l-SFT u jenħtieġ li ma jerġgħux jirriġeneraw wiehed ġdid għal kull tiġdid.
151. Jenħtieġ li l-kontroparti mhux ġeneratriċi tkun kapaċi tinkorpora fis-sistemi tagħha jew fis-sistemi tal-entità responsabbli għar-rapportar jew tal-entità li tirrapporta il-UTI ikkomunikat mill-kontroparti li ġġeneratu.
152. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jistabbilixxu l-arranġamenti tekniċi rilevanti, adegwati għall-volum ta' *data* li tkun se tiġi skambjata, biex jiżguraw il-komunikazzjoni u l-inkorporazzjoni puntwali tal-UTI. F'każ li jkun hemm problema fil-ġenerazzjoni jew fil-komunikazzjoni tal-UTI, jenħtieġ li l-kontropartijiet jiżguraw is-soluzzjoni puntwali ta' kwalunkwe problema relatata mal-ġenerazzjoni u mal-komunikazzjoni tal-UTI u jirrapportaw skont l-iskeda ta' żmien għar-rapportar tal-SFT.
153. Jekk il-UTI stess huwa żbaljat, il-kummerċ jenħtieġ li jiġi kkanċellat u rrapportat bħala ġdid bil-UTI korrett.
154. Fuq il-format tal-UTI, il-kontropartijiet għal SFT jistgħu jikkunsidraw li jużaw il-gwida tas-CPMI-IOSCO li tirrakkomanda li l-UTIs il-ġodda jkunu strutturati bħala kombinazzjoni kkonċatenata ta':
  - a. l-LEI tal-entità tal-ġenerazzjoni kif kien validu fil-mument tal-ġenerazzjoni, u
  - b. valur uniku maħluq minn dik l-entità (fejn dan il-valur jeħtieġ li jkun uniku biss fis-sett ta' valuri bħal dawn iġġenerat minn dik l-entità peress li l-kombinazzjoni mal-LEI tiggarrantixxi unicità globali).

#### **4.17 Identifikazzjoni u rapportar dwar il-benefiċjarji**

155. Każ tas-soltu, iżda jista' jkun hemm oħrajn, huma l-istrutturi umbrella u s-sottofondi, fejn il-fond umbrella jkun il-kontroparti u s-sottofondi jew is-sottofondi jkunu l-benefiċjarji.
156. Jista' jkun hemm ukoll każijiet li fihom il-benefiċjarju jkun grupp delimitat; f'dawn il-każijiet, jenħtieġ li jintuża l-LEI biex jiġi identifikat it-tali grupp delimitat<sup>7</sup>.

#### **4.18 Identifikazzjoni tal-emittent tat-titoli u t-titoli**

157. Il-kontropartijiet jenħtieġ li jirrapportaw l-LEI tal-emittent(i) tat-titoli mogħtija jew meħuda b'self, l-LEI tal-emittent(i) tat-titoli użati bħala kollateral, kif ukoll l-ISINs tat-titoli.
158. Meta jirrapportaw din l-informazzjoni, jenħtieġ li l-kontropartijiet jiżguraw li jkun hemm korrispondenza bejn l-ISIN u l-LEI tal-emittent irrapportat f'konformità mar-regoli ta' validazzjoni.

---

<sup>7</sup> Kif imsemmi fir-Rakkomandazzjoni Nru 8 tar-rapport tal-FSB tal-2012 "A Global Legal Entity Identifier for Financial Markets" gruppi ta' assi jew partijiet segregati oħra ta' entità ġuridika jista' jkollhom drittijiet u obbligi separati f'livell suffiċjenti ta' indipendenza ta' dik l-entità ġuridika u jkunu eliġibbli għal LEI. Dan huwa wkoll f'konformità mal-istandard ISO 17442:2012 għal Identifikatur Legali.



## 4.19 Proċedura meta kontroparti tgħaddi minn azzjoni korporattiva

159. L-entità bl-LEI il-ġdid (eż. entità fuża jew akkwirenti— iktar il-quddiem “entità ġdida”) jenħtieġ li tinnofika lit-TR(s) li lilhom irrapportat I-SFTs tagħha dwar it-tibdil u titlob aġġornament tal-identifikatur fl-SFTs pendenti skont il-paragrafu 162 hawn taħt. Jekk it-tibdil fl-identifikatur jirriżulta minn fużjoni jew minn akkwist, l-entità fuża jew akkwirenti jenħtieġ li taġġorna wkoll kif xieraq ir-rekord tal-LEI tal-entità akkwistata/fuża. Fejn applikabbli, jenħtieġ li l-kontroparti tipprovdi wkoll informazzjoni dwar it-tibdil fil-pajjiż.
160. Fil-każ ta’ avvenimenti ta’ ristrutturar korporattiv li jaffettwaw I-SFTs kollha pendenti, jenħtieġ li t-TR jidentifika I-SFTs kollha pendenti fejn l-entità tkun identifikata bl-LEI l-antik fi kwalunkwe wieħed mill-kampijiet li ġejjin: ID tal-kontroparti li tirrapporta, ID tal-kontroparti l-oħra, u tissostitwixxi l-LEI l-antik bil-ġdid.
161. Avvenimenti oħra ta’ ristrutturar korporattiv, bħal, iżda mhux limitati għal, akkwizzizzjonijiet parzjali, spin-offs, jistgħu jaffettwaw biss subsett ta’ SFTs pendenti, f’liema każ l-entità l-ġdida jenħtieġ li tipprovdi kif xieraq lit-TR bil-UTIs tal-SFTs affettwati minn dak l-avveniment.
162. Dan isir permezz tal-proċess ikkontrollat li ġej:
- Jenħtieġ li l-entità l-ġdida tippreżenta dokumentazzjoni bil-miktub lit-TR(s) li għalih hija rrapportat I-SFTs tagħha u titlob it-tibdil fl-LEI minħabba avveniment korporattiv. Fid-dokumentazzjoni, l-informazzjoni li ġejja jenħtieġ li tiġi ppreżentata b’mod ċar (i) l-LEI(s) tal-entitajiet li jipparteċipaw fil-fużjoni, fl-akkwiżizzjoni jew f’avveniment korporattiv ieħor, (ii) l-LEI tal-entità l-ġdida, (iii) id-data li fiha jseħh it-tibdil u (iv) il-UTIs tal-SFTs pendenti kkonċernati.  
  
F’każ ta’ fużjoni jew ta’ akkwist, jenħtieġ li d-dokumentazzjoni tinkludi evidenza jew prova li l-avveniment korporattiv ikun seħh jew ser iseħh u jiġi ffirmat kif xieraq. Sa fejn ikun possibbli, jenħtieġ li l-entità tipprovdi l-informazzjoni meħtieġa minn qabel sabiex it-tibdil ma jseħh b’mod retrospettiv, iżda mid-data speċifikata fi (iii). Ta’ min jinnota li n-nuqqas ta’ aġġornament tal-LEI il-ġdid fil-hin jirriżulta f’rifjut tar-rapporti sottomessi mill-entità f’każ fejn tkun ġiet identifikata qabel bl-LEI l-antik bi status xieraq (jiġifieri “Maħruġ”, “Trasferiment pendenti” jew “Arkivjar pendenti”) u dak l-istatus sussegwentement ikun inbidel għal “Fuża”.
  - Jenħtieġ li t-TR ixandar din l-informazzjoni lit-TRs l-oħrajn kollha permezz ta’ fajl speċifiku, fejn (i) l-LEI(s) l-antiki, (ii) l-LEI(s) il-ġodda u (iii) id-data li minnha jenħtieġ li jsir it-tibdil, huma inkluzi. Sa fejn ikun possibbli, jenħtieġ li l-fajl ikun imxandar minn qabel sabiex it-tibdil ma jseħh b’mod retrospettiv, iżda mid-data speċifikata fi (iii).
  - Kull kontroparti għall-SFTs, fejn tiġi identifikata kwalunkwe waħda mill-entitajiet fużi, jenħtieġ li tkun informata dwar il-modifika mit-TR li jirrapportaw għandu.
  - Jenħtieġ li t-TR(s) jinnotifika wkoll lir-regolaturi li jkollhom aċċess għad-*data* relatata mal-SFTs li jkunu ġew aġġornati.
  - Fejn applikabbli, jenħtieġ li t-TR jaġġorna l-Kamp 1.12 “Pajjiż tal-kontroparti l-oħra”.
  - Jenħtieġ li t-tibdiliet jinżammu fir-reġistru ta’ rapportar miżmum minn kull TR.



163. Jenħtiegħ li r-rapporti sussegwenti jiġu vvalidati fid-dawl tal-GLEIF bħas-soltu u jiġu rrifjutati jekk il-validazzjoni ma titlestie x b'suċċess.
164. Għalhekk, mhuwiex mistenni li entità tippreżenta rapport bħala riżultat ta' LEI ġdid.
165. Jenħtiegħ li l-proċedura msemmija hawn fuq ma tiġix segwita meta l-kontropartijiet jidentifikaw lilhom infushom b'mod żbaljat. F'dak il-każ, jenħtiegħ li huma jissottomettu rapport tal-SFT bit-tip ta' azzjoni "EROR", jaqblu dwar UTI ġdid mal-kontroparti l-oħra u jirrapportaw id-dettalji kompluti u preċiżi tal-SFT.

## 4.20 Rapportar fil-perjodu ta' introduzzjoni gradwali

166. Jenħtiegħ li l-kontropartijiet li għalihom l-obbligu tar-rapportar ma jkunx għadu beda jipprovdu lill-kontroparti li għaliha beda l-obbligu tar-rapportar bl-informazzjoni rilevanti kollha f'konformità mat-TS dwar ir-rapportar. L-informazzjoni li jenħtiegħ li titwassal għand il-kontroparti li tirrapporta tikkonsisti f' 2 kampijiet tad-*data*. Dawk il-kampijiet tad-*data* huma l-"Kontroparti l-oħra", il-"Fergħa tal-kontroparti l-oħra" u l-"Pajjiż tal-kontroparti l-oħra". Għal dawn il-kampijiet tad-*data*, l-informazzjoni jenħtiegħ li titwassal għand il-kontroparti li tirrapporta b'mod puntwali.
167. Jekk il-kontropartijiet, li għalihom l-obbligu ta' rapportar ma jkunx għadu beda, isibuha aktar faċli, dawn jistgħu jibdeu jirrapportaw minn qabel id-*data* tal-bidu tar-rapportar rilevanti indikata fl-Artikolu 33(2)(a) tal-SFTR. Jekk kontroparti li għaliha l-obbligu ta' rapportar ikun għadu ma bediex tiddeċiedi li tirrapporta t-tranzazzjonijiet, jenħtiegħ li ssegwi l-paragrafu 144 fit-taqsim 4.15 tal-Linji Gwida.

## 5 Tabelli tal-kampijiet tal-SFTR

168. L-Artikolu 1(1) tal-RTS dwar ir-rapportar jistabbilixxi li "Rapport li jsir skont l-Artikolu 4(1) tar-Regolament (UE) 2015/2365 għandu jinkludi d-dettalji kompluti u preċiżi stabbiliti fit-Tabelli 1, 2, 3 u 4 tal-Anness li jirrigwardaw l-SFT ikkonċernata." Il-każijiet ta' użu inklużi fit-Taqsimiet 5.1 sa 5.6 mhux bilfors ikunu jinkludu l-kampijiet kollha li jappartjenu għall-SFT ikkonċernata, iżda jiffokaw fuq taqsimiet speċifiċi tal-kampijiet tad-*data* sabiex jipprovdu gwida aktar granulari u dettaljata dwar ir-rapportar mingħajr ebda ripetizzjoni jew inklużjoni żejda ta' elementi oħra tad-*data*.
169. Ir-regoli dwar il-validazzjoni jinkludu l-gwida kompluta dwar il-kampijiet applikabbli għal kull tip ta' SFT, Tip ta' azzjoni u Livell, kif ukoll id-dipendenzi rilevanti.
170. It-taqsimiet li ġejjin jinkludu diversi xenarji u tabelli korrispondenti li jiċċaraw kif jenħtiegħ li jiġu rrapportati dawn ix-xenarji. Kull tabella turi l-kampijiet ta' rapportar skont l-istandards tekniċi tal-SFTR. 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 "Messagġ XML" turi l-format tal-messagġ XML li jenħtiegħ li jiġi sottomess fir-rapport dwar il-kummerċ.
171. Sakemm ma jiġix iddikjarat mod ieħor fix-xenarju speċifiku, l-informazzjoni ta' sfond li ġejja tapplika għax-xenarji kollha stabbiliti fit-Taqsim 5:

Il-kontroparti A hija kontroparti finanzjarja identifikata bl-LEI 12345678901234500000

Il-kontroparti B hija kontroparti finanzjarja Franciża identifikata bl-LEI ABCDEFGHIJKLMNOPQRST

Il-kontroparti Ċ hija SME-NFC identifikata bl-LEI 123456789ABCDEFGHIJK

Il-kontroparti D identifikata bl-LEI 11223344556677889900

Is-sensar E huwa identifikat bl-LEI 88888888888888888888

L-aġent sellief F huwa identifikat bl-LEI BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB

L-aġent tripartitiku G huwa identifikat bl-LEI 77777777777777777777

Il-bank kustodju H huwa identifikat bl-LEI AAAAAAAAAAAAAAAAAAAAAA

Il-parti terza I toffri servizzi ta' rapportar u hija identifikata bl-LEI 12345123451234512345

Il-kontroparti J taġixxi wkoll bħala membru tal-ikklijar u hija identifikata bl-LEI CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC

Il-fond tal-UCITS K huwa identifikat bl-LEI UUUUUUUUUU1111111111, filwaqt li l-kumpanija ta' ġestjoni tal-UCITS L hija identifikata bl-LEI UUUUUUUUUU2222222222

L-AIF M huwa identifikat bl-LEI AAAAAAAAAA1111111111 filwaqt li l-kumpanija ta' ġestjoni tal-AIF N hija identifikata bl-AAAAAAAAAAA2222222222

Is-CCP O hija identifikata bl-LEI BBBBBBBBBB1111111111

L-emittent tat-titoli Ġermaniż huwa identifikat bl-NNNNNNNNNNNNNNNNNNNN

L-emittent tat-titoli Spanjol huwa identifikat bl-LEI EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE

L-emittent tat-titoli Franciż huwa identifikat bl-LEI FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF

L-emittent tat-titoli Olandiż huwa identifikat bl-LEI DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD

L-emittent tat-titoli Taljan huwa identifikat bl-LEI IIIIIIIIIIIIIIIIIIIII

Emittent ġenerali tat-titoli huwa identifikat b'GGGGGGGGGGGGGGGGGGGG

L-emittent tal-ekwitajiet ta' indiċi ewlieni Franciż huwa identifikat bl-LEI 529900S21EQ1BO4ESM68

Iċ-Ċentru tan-Negozjar P huwa identifikat b'MIC XWAR

It-titoli huma identifikati bl-ISINs li ġejjin:

a. Bonds Ġermaniżi (Vanilla): DE0010877643

b. Bonds perpetwi Spanjoli: ES0010877643

- c. Bonds Franciżi: FR0010877643
- d. Bonds Olandiżi: NL0010877643
- e. Ekwitajiet ta' indiċi ewlieni Franciż: FR0000120271
- f. Titoli Franciżi oħrajn: FR0010877000
- g. Basket ta' kollateral: GB00BH4HKS39
- h. Komponent ta' kollateral 1: IT00BH4HKS39
- i. Komponent ta' kollateral 2: FR00BH4HKS39

It-titoli huma kklassifikati bis-CFIs li ġejjin:

- a. Bond vanilla tal-gvern: DBFTFR
- b. Bond perpetwu tal-gvern: DBFTPR
- c. Ekwitajiet: ESVUFN

Il-kampijiet fit-tabelli li huma vojta u bil-griż mhumiex applikabbli għal dawk l-eżempji speċifiċi iżda jintwerew għal fini ta' kjarifika.

L-applikabbiltà tal-każijiet ta' użu għat-tipi differenti ta' SFTs hija inkluża. Ir-rapportar attwali skont l-iskemi XML tal-ISO 20022 huwa pprovdut ukoll.

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

- 172. Meta SFT tiġi kklirjata, kull kontroparti jenħtieġ li tirrapporta l-membri tal-ikklijar tagħha fil-kamp tal-membri tal-ikklijar.
- 173. Meta tkun teżisti delega volontarja tar-rapportar jew tal-allokkazzjoni ta' responsabbiltà, l-entità li tippreżenta r-rapportar jew l-entità responsabbli għar-rapportar jenħtieġ li tippreżenta d-*data* dwar il-kontroparti b'mod separat, u d-*data* dwar is-self u l-kollateral għal kull wieħed miż-żewġ naħat irrapportati.
- 174. Meta jkun hemm każijiet ta' użu li jkopru żewġ każijiet ta' użu jew aktar inklużi hawn taħt, il-kontropartijiet li jirrapportaw jew l-entitajiet responsabbli għar-rapportar jenħtieġ li jinkludu d-dettalji rilevanti kollha abbażi tal-gwida ta' hawn taħt.

**Tabella 7 – Każijiet ta' użu**

	Repo and reverse repo	BSB / SBB	Securities and commodities lending	Margin lending
Non-cleared bilateral SFT between headquarters	Y	Y	Y	Y
Non-cleared bilateral SFT between branches	Y	Y	Y	Y
Non-cleared bilateral SFT with beneficiaries	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with brokers, settled with a custodian bank	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFT with broker, agent lender and tri-party agent, settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party	Y	Y	Y	N
Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent	Y	Y	Y	N
Cleared SFT with broker, agent lender, tri-party agent settled with a CSD participant different from any of the entities and voluntary delegation of reporting to a third party	Y	Y	Y	N
Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund	Y	Y	Y	Y

**Tabella 7 – Każijiet ta’ użu**

	Repo and reverse repo	BSB / SBB	Securities and commodities lending	Margin lending
Non-cleared SFTs concluded by UCITS fund, and the UCITS management company delegates reporting to a third party	Y	Y	Y	Y
Non-cleared SFTs concluded by AIF	Y	Y	Y	Y
Non-cleared SFTs where fund portfolio management is outsourced	Y	Y	Y	Y

#### 5.1.1 SFTs bilaterali mhux ikklirjati bejn il-kwartieri ġenerali

175. Tabella 8 turi liema tipi ta’ tranżazzjonijiet ta’ finanzjament tat-titoli jistgħu jitwettqu purament b’mod bilaterali bejn żewġ kwartieri ġenerali.

**Tabella 8 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta’ użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

176. It-Tabella 9 turi r-rapportar għal tranżazzjoni bilaterali fejn il-kontroparti li tirrapporta (il-kontroparti A) tkun qed tippreżenta wkoll ir-rapporti tagħha (jiġifieri m’hemmx entità separata li tissottometti rapport). Il-kontroparti A hija wkoll il-benefiċjarju għal din it-tranżazzjoni u l-partecipant tas-CSD.

**Tabella 9 - SFTs bilaterali mhux ikklirjati bejn kwartieri generali**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2021-02-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		<LEI>12345678901234500000</LEI>
7	Branch of the reporting counterparty		</Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
12	Country of the other Counterparty	FR	</Id> <CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty>
13	Beneficiary		<NttyRspnsblForRpt>
14	Tri-party agent		<LEI>12345678901234500000</LEI>
15	Broker		</NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData> <SttlmPties>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		</SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData>

**Tabella 9 - SFTs bilaterali mhux ikklirjati bejn kwartieri ġenerali**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.2 SFT bilaterali mhux ikklirjata bejn fergħat

**Tabella 10 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

177. It-Tabella 11 turi eżempju ta' rapportar ta' tranżazzjoni bilaterali konkluża bejn fergħat ta' żewġ kontropartijiet. L-entitajiet ġuridici (kwartieri ġenerali) jiġu identifikati bl-LEIs rispettivi, filwaqt li l-pajjiżi tal-fergħat jiġu identifikati bil-kodiċijiet tal-pajjiżi tal-ISO. Il-kontroparti A hija wkoll il-partecipant tas-CSD.

**Tabella 11 - SFT bilaterali mhux ikklirjata bejn fergħat**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty	FR	



**Tabella 11 - SFT bilaterali mhux ikklirjata bejn fergħat**

No	Field	Example	XML Message
8	Branch of the other counterparty	DE	<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Brnch> <Ctry>FR</Ctry>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</Brnch> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
12	Country of the other Counterparty	FR	<OthrCtrPty> <Id>
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
14	Tri-party agent		</Id> <Brnch>
15	Broker		<Ctry>DE</Ctry>
16	Clearing member		</Brnch> <CtryCd>FR</CtryCd>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
18	Agent lender		<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>  <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>  <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData>  ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

### 5.1.3 SFT bilaterali mhux ikklirjata ma' benefiċjarji

Tabella 12 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

178. It-Tabella 13 turi eżempju ta' tranżazzjoni bilaterali mhux ikklirjata fejn il-kontroparti A mhijiex benefiċjarju għat-tranżazzjoni. Il-benefiċjarju huwa l-kontroparti D. Il-kontroparti A hija wkoll il-partecipant tas-CSD.

Tabella 13 - SFT bilaterali mhux ikklirjata ma' benefiċjarji			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt;         &lt;RptSubmitgNtty&gt;           &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;           &lt;/RptSubmitgNtty&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;Ntr&gt;                 &lt;FI&gt;                   &lt;Clssfctn&gt;CDTI&lt;/Clssfctn&gt;                 &lt;/FI&gt;               &lt;/Ntr&gt;               &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;             &lt;OthrCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;CtryCd&gt;FR&lt;/CtryCd&gt;             &lt;/OthrCtrPty&gt;             &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;           </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other Counterparty	FR	
13	Beneficiary	{LEI} of counterparty D	

Tabella 13 - SFT bilaterali mhux ikklijrjata ma' beneficijarji			
No	Field	Example	XML Message
14	Tri-party agent		<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;Bnfcry&gt; </pre>
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<pre> &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/Bnfcry&gt; &lt;SttlmPties&gt; &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt; </pre>
18	Agent lender		<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt; &lt;/SttlmPties&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.1.4 SFT mhux ikklijrjata ma' sensara finanzjarji, saldata b'bank kustodju

Tabella 14 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

179. Fix-xenarju muri fit-Tabella 15, il-kontroparti A tidhol fi tranzazzjoni mal-kontroparti B. Il-kontroparti A tuża bank kustodju H li, għalhekk, huwa identifikat fil-Kamp 1.17. Barra minn hekk, il-kontroparti A tuża s-servizzi tas-sensar finanzjarju E.

Tabella 15 - SFT mhux ikklirjata ma' sensara finanzjarji, saldata b'bank kustodju			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-0115:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptSubmitgNtty> <CtrPtyData>
6	Additional sector classification		<RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clsfctn>CDTI</Clsfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other Counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent		<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<Brkr> <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr>
18	Agent lender		<SttlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt> <LEI> AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>

Tabella 15 - SFT mhux ikklirjata ma' sensara finanzjarji, saldata b'bank kustodju			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.5 SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku

Tabella 16 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu			
Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

180. Fix-xenarju muri fit-Tabella 17, il-kontroparti A tidhol fi tranzazzjoni mal-kontroparti B. Il-kontroparti A tuża agent sellief F u agent tripartitiku G. Barra minn hekk, il-kontroparti A tuża s-servizzi tas-sensar finanzjarju E. Il-kontroparti A hija l-partecipant tas-CSD.

Tabella 17 - SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

**Tabella 17 - SFT mhux ikklijrata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku**

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	</RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
8	Branch of the other counterparty		<Ntr> <FI>
9	Counterparty side	GIVE	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNQPQRST</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>  <LEI>12345678901234500000</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr>  <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>  <LnData> ... </LnData>

**Tabella 17 - SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.6 SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku, saldata ma' parteċipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza.

**Tabella 18 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

181. Fix-xenarju muri fit-Tabella 19, il-kontroparti A tidhol fi tranżazzjoni mal-kontroparti B. Il-kontroparti A tuża aġent sellief F u aġent tripartitiku G. Barra minn hekk, il-kontroparti A tuża s-servizzi tas-sensar finanzjarju E u tal-bank kustodju H. Finalment, il-kontroparti A tiddeliga r-rapportar lil parti terza I.

**Tabella 19 - SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' aġent sellief u ma' aġent tripartitiku, saldata ma' parteċipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza.**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01- 01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<pre> &lt;LEI&gt;12345123451234512345&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; </pre>



**Tabella 19 - SFT mhux ikklijrata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku, saldata ma' partecipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza.**

No	Field	Example	XML Message
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id> <Ntr>
9	Counterparty side	GIVE	<FI> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
13	Beneficiary		</Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of Broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member		<OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<TrptyAgt> <LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt> <LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr> <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ...

**Tabella 19 - SFT mhux ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku, saldata ma' partecipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza.**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.7 SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku

**Tabella 20 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

182. It-Tabella 21 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' SFT ikklirjata. Il-popolazzjoni tal-kampijiet m'għandhiex x'taqsam mat-tip ta' aċċess li l-kontroparti jkollha għas-CCP. Dan dejjem jenfiteg li jidentifika l-entità li taġixxi bħala membru tal-ikklirjar.
183. Il-kontroparti A taċċessa s-CCP permezz tal-membru tal-ikklirjar J. Hija tuża wkoll is-servizzi tas-sensar finanzjarju E, tal-aġent sellief F u tal-aġent tripartitiku G. Il-kontroparti A hija wkoll il-partecipant tas-CSD.
184. Ta' min jinnota li l-kamp tas-CCP jappartjeni għat-Tabella 2 (*Data* dwar is-self u l-kollateral), u għalhekk il-popolazzjoni tiegħu hija koperta fit-Taqsima 5.2.

**Tabella 21 - SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;  ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of counterparty A	
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

**Tabella 21 - SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku**

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345678901234500000</LEI>
6	Additional sector classification		</RptSubmitgNtty> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <FI>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<Clssfctn>CDTI</Clssfctn> </FI> </Ntr>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	
13	Beneficiary		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> <OthrPtyData>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of counterparty A	<TrptyAgt>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>  <LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb>  <LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI> </ClrMmb> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>  <LEI>12345678901234512345</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> <AgtLndr>

**Tabella 21 - SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBBBB &lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ...   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.8 SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku, saldata ma' partecipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza

**Tabella 22 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	N

185. Bi-istess mod bħall-eżempju preċedenti, it-Tabella 23 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' SFT ikklirjata u l-Kontroparti A taċċessa s-CCP permezz tal-membru tal-ikklijar J. Hija tuża wkoll is-servizzi tas-sensar finanzjarju E, tal-agent sellief F u tal-agent tripartitiku G. Barra minn hekk, f'dan l-eżempju t-tranzazzjoni tiġi saldata ma' entità H differenti minn kwalunkwe waħda mill-kontropartijiet u l-kontroparti li tirrapporta tiddelega r-rapportar lil parti terza I.

186. Ta' min jinnota li l-popolazzjoni tal-kampijiet m'għandhiex x'taqsam mat-tip ta' aċċess li l-kontroparti jkollha għas-CCP. Dan dejjem jenħtieġ li jidentifika l-entità li taġixxi bħala membru tal-ikklijar.

**Tabella 23 - SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku, saldata ma' partecipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-0115:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	<Rpt> <New>
3	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	... <CtrPtyData>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<RptgDtTm>2020-01-01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	CDTI	<LEI>12345123451234512345</LEI> </RptSubmitgNtty>
6	Additional sector classification		<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
7	Branch of the reporting counterparty		<LEI>12345678901234500000</LEI>
8	Branch of the other counterparty		</Id>
9	Counterparty side	GIVE	<Ntr> <Fl> <Clssfctn>CDTI</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	</Fl> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
13	Beneficiary		<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty>
14	Tri-party agent	{LEI} of tri-party agent G	<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker	{LEI} of broker E	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
16	Clearing member	{LEI} of counterparty J	<OthrPtyData> <TrptyAgt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>77777777777777777777</LEI> </TrptyAgt> <Brkr>
18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<LEI>88888888888888888888</LEI> </Brkr> <ClrMmb>
			<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC</LEI>

**Tabella 23 - SFT ikklirjata ma' sensar finanzjarju, ma' agent sellief u ma' agent tripartitiku, saldata ma' partecipant tas-CSD differenti minn kwalunkwe entità u delegazzjoni volontarja tar-rapportar lil parti terza**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/ClrMmb&gt; &lt;SttlmPties&gt;   &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;     &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;     &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;   &lt;/SttlmPties&gt;   &lt;AgtLndr&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB &lt;/LEI&gt;     &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   ... &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ... &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.1.9 SFTs mhux ikklirjati konkluzi minn fond tal-UCITS

**Tabella 24 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

187. It-Tabella 25 turi r-rapportar ta' SFT konkluzi mill-fond tal-UCITS K. F'konformità mal-Artikolu 4(3) tal-SFTR, il-kumpanija ta' ġestjoni tal-UCITS L hija responsabbli għar-rapportar f'isem il-UCITS, u għalhekk hija identifikata fiż-żewġ kampijiet "2.2" Entità li tippreżenta r-rapport u "2.10" Entità responsabbli għar-rapportar. It-tranzazzjoni tiġi saldata mal-bank kustodju H.

**Tabella 25 - SFTs mhux ikklirjati konkluzi minn fond tal-UCITS**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>
2	Report submitting entity	{LEI} of UCITS management company L	... <CtrPtyData> <RptgDtTm>2020-01-
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	01T15:15:15Z</RptgDtTm> <RptSubmitgNtty>
4	Nature of the reporting counterparty	F	<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> </RptSubmitgNtty>
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
6	Additional sector classification		<LEI>UUUUUUUUUU1111111111</LEI>
7	Branch of the reporting counterparty		</Id> <Ntr>
8	Branch of the other counterparty		<FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn>
9	Counterparty side	GIVE	</FI> </Ntr>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	<Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<CtryCd>FR</CtryCd> </OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
15	Broker		<OthrPtyData>
16	Clearing member		<StlmPties> <CntrlSctiesDpstryPtcpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSctiesDpstryPtcpt> </StlmPties>
18	Agent lender		</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ...



**Tabella 25 - SFTs mhux ikklirjati konklużi minn fond tal-UCITS**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CollData&gt;  ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.1.10 SFTs mhux ikklirjati konklużi minn fond tal-UCITS, u l-kumpanija ta' ġestjoni tal-UCITS tiddelega r-rapportar lil parti terza

**Tabella 26 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

188. It-Tabella 27 turi r-rapportar ta' SFT konkluża mill-fond tal-UCITS K. F'konformità mal-Artikolu 4.3 tal-SFTR, il-kumpanija ta' ġestjoni tal-UCITS L hija responsabbli għar-rapportar f'isem il-UCITS, u għalhekk din hija identifikata fil-Kamp 2.10 "Entità responsabbli għar-rapportar", iżda tiddeciedi li tiddelega lill-parti terza I li hija inkluża fil-Kamp 2.2 "Entità li tippreżenta r-rapport". It-tranzazzjoni tiġi saldata mal-bank kustodju H.

**Tabella 27 - SFTs mhux ikklirjati konklużi minn fond tal-UCITS**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;  ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;12345123451234512345&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;UUUUUUUUUUU1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Ntr&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of third party I	
3	Reporting counterparty	{LEI} of UCITS K	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	UCIT	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		

**Tabella 27 - SFTs mhux ikklijati konkluzi minn fond tal-UCITS**

No	Field	Example	XML Message
9	Counterparty side	GIVE	<FI> <Clssfctn>UCIT</Clssfctn>
10	Entity responsible for the report	{LEI} of UCITS management company L	</FI> </Ntr> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty>
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	<OthrCtrPty> <Id>
12	Country of the other counterparty	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id> <CtryCd>FR</CtryCd>
13	Beneficiary		</OthrCtrPty>
14	Tri-party agent		<NttyRspnsblForRpt>
15	Broker		<LEI>UUUUUUUUUU2222222222</LEI>
16	Clearing member		</NttyRspnsblForRpt>
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	<OthrPtyData> <SttlmPties> <CntrlSciesDpstryPtcpt>
18	Agent lender		<LEI>AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA</LEI> </CntrlSciesDpstryPtcpt> </SttlmPties> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> ... </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

5.1.11 SFTs mhux ikklijati konkluzi minn AIF

**Tabella 28 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

189. It-Tabella 29 turi r-rapportar ta' SFT konkluzja minn fond AIF M. F'konformità mal-artikolu 4.3 tal-SFTR, il-kumpanija ta' ġestjoni tal-AIF N hija responsabbli għar-rapportar f'isem l-AIF, u għalhekk hija identifikata fiż-żewġ Kampijiet 2.2 "Entità li tipprezenta r-rapport" u 2.10 "Entità responsabbli għar-rapportar". It-tranzazzjoni tiġi saldata mal-bank kustodju H.

Tabella 29 - SFTs mhux ikklirjati konkluzi minn AIF			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;RptgDtTm&gt;2020-01- 01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt;           &lt;RptSubmitgNtty&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;           &lt;/RptSubmitgNtty&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA1111111111&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;Ntr&gt;                 &lt;FI&gt;                   &lt;Clssfctn&gt;AIFD&lt;/Clssfctn&gt;                 &lt;/FI&gt;               &lt;/Ntr&gt;               &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;             &lt;OthrCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;               &lt;/Id&gt;               &lt;CtryCd&gt;FR&lt;/CtryCd&gt;             &lt;/OthrCtrPty&gt;             &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;               &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;             &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;             &lt;OthrPtyData&gt;               &lt;SttlmPties&gt;                 &lt;CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;                   &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;                 &lt;/CntrlSciesDpstryPtcpt&gt;               &lt;/SttlmPties&gt;             &lt;/OthrPtyData&gt;           &lt;/CtrPtyData&gt;         </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	
4	Nature of the reporting counterparty	F	
5	Sector of the reporting counterparty	AIFD	
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other counterparty	FR	
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	
18	Agent lender		

**Tabella 29 - SFTs mhux ikklirjati konklużi minn AIF**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   ...   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.1.12 SFTs mhux ikklirjati fejn il-ġestjoni tal-portafolli tal-fondi tiġi esternalizzata

190. Fil-każ ta' esternalizzazzjoni tal-ġestjoni tal-portafolli lil entità differenti mill-kumpanija ta' ġestjoni tal-fondi, dik l-entità jenħtieġ li tkun irrapportata biss b'halha sensar finanzjarju, f'każ li taġixxi b'halha tali. Inkella jenħtieġ li din l-entità, b'mod simili g'hal entitajiet oħra li jistgħu jipparteċipaw direttament jew indirettament fl-SFT, ma tiġix irrappurtata f'xi kamp
191. Fix-xenarju muri fit-Tabella 31, il-ġestjoni tal-portafolli tal-AIF M hija ddelegata lil entità oħra li ma taġixxi b'halha sensar finanzjarju. It-tranzazzjoni tiġi saldata mal-bank kustodju H.

**Tabella 30 – SFTs li għalihom japplika l-każ ta' użu**

Repo and reverse repo	Buy sell back/sell buy-back	Securities and commodities lending	Margin lending
Y	Y	Y	Y

**Tabella 31 - SFTs mhux ikklirjati fejn il-ġestjoni tal-portafolli tal-fondi tiġi esternalizzata**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-01-01T15:15:15Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;   ...   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;RptgDtTm&gt;2020-01-01T15:15:15Z&lt;/RptgDtTm&gt;   &lt;RptSubmitgNtty&gt; </pre>
2	Report submitting entity	{LEI} of AIF management company N	
3	Reporting counterparty	{LEI} of AIF M	
4	Nature of the reporting counterparty	F	

**Tabella 31 - SFTs mhux ikklirjati fejn il-gestjoni tal-portafolli tal-fondi tigi esternalizzata**

No	Field	Example	XML Message
5	Sector of the reporting counterparty	AIFD	<pre> &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;   &lt;/RptSubmitgNtty&gt;   &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA1111111111&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;Ntr&gt;         &lt;FI&gt;           &lt;Clssfctn&gt;AIFD&lt;/Clssfctn&gt;         &lt;/FI&gt;       &lt;/Ntr&gt;       &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;     &lt;/RptgCtrPty&gt;     &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;CtryCd&gt;FR&lt;/CtryCd&gt;     &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;     &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;     &lt;OthrPtyData&gt;       &lt;Brkr&gt;         &lt;LEI&gt;           AAAAAAAAAA2222222222&lt;/LEI&gt;         &lt;/Brkr&gt;         &lt;SttlmPties&gt;           &lt;CntrlSctiesDpstryPtcpt&gt;             &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;           &lt;/CntrlSctiesDpstryPtcpt&gt;           &lt;/SttlmPties&gt;           &lt;/OthrPtyData&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;           &lt;LnData&gt;             ...           &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/New&gt; </pre>
6	Additional sector classification		
7	Branch of the reporting counterparty		
8	Branch of the other counterparty		
9	Counterparty side	GIVE	
10	Entity responsible for the report	{LEI} of AIF management company N	
11	Other counterparty	{LEI} of counterparty B	
12	Country of the other counterparty	FR	
13	Beneficiary		
14	Tri-party agent		
15	Broker		
16	Clearing member		
17	Central Securities Depository ('CSD') participant or indirect participant	{LEI} of custodian bank H	
18	Agent lender		

**Tabella 31 - SFTs mhux ikklirjati fejn il-ġestjoni tal-portafolli tal-fondi tiġi esternalizzata**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

## 5.2 Data dwar is-Self u l-Kollateral

192. Wara l-popolazzjoni tal-kampijiet tad-*data* dwar il-kontroparti, hija inkluża l-popolazzjoni tal-kampijiet dwar is-self u l-kollaterali għal każijiet ta' użu differenti. Ir-rapportar skont l-iskemi XML tal-ISO 20002 huwa pprovdut ukoll. Dan jiffaċilita l-popolazzjoni tal-kampijiet mill-kontropartijiet.

193. Kull subtaqsima tinkludi deskrizzjoni qasira tal-logika tar-rapportar għall-kampijiet li jkunu qed jiġu diskussi.

5.2.1 Ir-rapportar tat-tipi ta' azzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet u fil-livell tal-pożizzjonijiet.

5.2.1.1 SFT bilaterali ġdida fil-livell tat-tranzazzjonijiet li ma ġietx ikklirjata

194. It-Tabella 32 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' SFT ġdida, li mhijiex ikklirjata. Dan huwa l-mod kif l-SFTs bilaterali jenħtieġ li jiġu rrapportati, fil-livell tat-tranzazzjonijiet.

**Tabella 32- SFT ġdida fil-livell tat-tranzazzjonijiet li ma ġietx ikklirjata**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;           &lt;ClrSts&gt;             &lt;NonClrd&gt;NORE&lt;/NonClrd&gt;           &lt;/ClrSts&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           ...         &lt;/CollData&gt; </pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

**Tabella 32- SFT ġdida fil-livell tat-tranzazzjonijiet li ma ġietx ikklirjata**

No	Field	Example	XML Message
			<pre>&lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt;</pre>

5.2.1.2 SFT bilaterali ġdida fil-livell tat-tranzazzjonijiet li hija i) ikklirjata fl-istess jum ii) jew wara.

195. It-Tabella 33, it-Tabella 34, u t-Tabella 35 juru l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar minn CP (mhux is-CCP) f'każ ta' SFT ġdida fejn it-tranzazzjoni tkun i) eżegwita bilateralmment u kklirjata wara fl-istess jum jew ii) ikklirjata f'jum wara dak tal-konkluzjoni tagħha f'centru. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jipprezentaw rapport tal-SFT bit-tip ta' azzjoni "ETRM", li ma jippermettix li l-popolazzjoni tal-Kamp "Ikklirjata" tindika t-terminazzjoni bikrija tan-negozju rrapportat bħala mhux ikklirjat. Wara dan, jenħtieġ li l-kontroparti tipprezenta rapport tal-SFT bit-tip ta' azzjoni "NEWT" biex tindika li l-SFT tkun ġiet ikklirjata. Is-sekwenza tas-sottomissjonijiet hija illustrata mit-Tabella 33, mit-Tabella 34, u mit-Tabella 35 rispettivament.

**Tabella 33 - SFT bilaterali ġdida fil-livell tat-tranzazzjonijiet li hija kklirjata fl-istess jum jew wara.**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT11	<pre>&lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;NonClrd&gt;NORE&lt;/NonClrd&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt;</pre>
5	Cleared	false	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	



**Tabella 34 – Terminazzjoni tal-SFT bilaterali fil-livell tat-tranzazzjonijiet minhabba kklirjar fl-istess jum jew wara.**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;EarlyTermntn&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/EarlyTermntn&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

**Tabella 35 – SFT ġdida kklirjata fil-livell tat-tranzazzjonijiet li tirrizulta mill-ikklijar ta' SFT bilaterali fl-istess jum jew wara.**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;RpTrad&gt;         &lt;UnqTradldr&gt;UTI2&lt;/UnqTradldr&gt;         &lt;ClrSts&gt;           &lt;Clrd&gt;             &lt;RptTrckgNb&gt;UTI1&lt;/RptTrckgNb&gt;           &lt;/Clrd&gt;         &lt;/ClrSts&gt;       &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt; </pre>
2	Report tracking number	UTI1 <sup>8</sup>	
5	Cleared	true	
98	Action type	NEWT	
99	Level	TCTN	

<sup>8</sup> Mill-perspettiva tal-klijent tas-CM, mhux applikabbli għar-rapport tas-CCP.

**Tabella 35 – SFT ġdida kklirjata fil-livell tat-tranzazzjonijiet li tirrizulta mill-ikklijar ta' SFT bilaterali fl-istess jum jew wara.**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

196. Kun af li r-rapport tat-Tabella 33 u tat-Tabella 34 ma jkunx mistenni jekk in-negozju jiġi konkluz f'centru tan-negozjar minn kontropartijiet li jkunu wkoll il-membri tal-ikklijar u kklirjati minn kontroparti ċentrali fl-istess jum, u jkun mistenni biss ir-rapport tat-Tabella 35. Barra minn hekk, it-Tabella 35 turi r-rapportar f'każ li fih SFT ikklirjata ma tkunx inkluża immedjatament f'pożizzjoni (f'liema każ tiġi rrapportata bit-tip ta' azzjoni POSC kif iċċarat fl-eżempji sussegwenti).

#### 5.2.1.3 SFT ġdida rrapportata bħala komponent ta' pożizzjoni

197. It-Tabella 36 u t-Tabella 37 juru l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' SFT ġdida<sup>9</sup> li tiġi rrapportata bħala komponent ta' pożizzjoni. Dan huwa kif jistgħu jiġu rrapportati l-SFTs li huma magħmula minn pożizzjoni kklirjata mis-CCP. Ara li s-sekwenzi murija mit-Tabella 36 u mit-Tabella 37 ġew żviluppati bil-kosiderazzjoni li l-SFT tiġi konkluz f'centru tan-negozjar u kklirjata minn kontroparti ċentrali fl-istess jum, u għalhekk l-SFT fil-forma kklirjata tagħha biss għandha tiġi rrapportata. Fil-kuntest tal-eżempji għal SFTs ikklirjati minn CCP, dawn huma identifikati b'Identifikatur Uniku tat-Tranzazzjoni (UTI) "PUT11".

198. Peress li din l-għażla hija rapportar supplimentari għal-livell tat-tranzazzjonijiet, ir-rapporti huma kif ġejjin. Jenhtieg li l-kontropartijiet ma jirrapportawx in-numru tat-traċċar tar-Rapport (Kamp 2.2) għal SFTs ikklirjati minn CCP:

**Tabella 36 - SFT ġdida konkluz f'centru tan-negozjar u kklirjata minn kontroparti ċentrali fl-istess jum u rrapportata bil-komponent tal-pożizzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;PosCmpnt&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	POSC <sup>10</sup>	
99	Level	TCTN	

<sup>9</sup> Ix-xenarji tal-SFTs ikklirjati huma mmarkati bħala applikabbli għal repos, għalkemm fil-prattika dawn ix-xenarji mhumiex mistennija. Il-livell tal-pożizzjonijiet mhuwiex possibbli għal Self b'Margni.

<sup>10</sup> Innata li n-negozji originali fil-livell tat-tranzazzjonijiet iridu jiġu rrapportati bil-komponent tal-pożizzjoni bħala tip ta' azzjoni.

**Tabella 36 - SFT ġdida konkluża f'centru tan-negozjar u kklirjata minn kontroparti ċentrali fl-istess jum u rrapportata bil-komponent tal-pożizzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI2&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt;  ...   &lt;/Clrd&gt; &lt;/ClrSts&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;                                  &lt;CollData&gt;                                 ...                                 &lt;/CollData&gt;   &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt;   &lt;/PosCmpnt&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

**Tabella 37 - SFT ġdida kklirjata mis-CCP irrapportata fil-livell tal-pożizzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;  ...   &lt;CtrPtyData&gt; ...   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt; </pre>
5	Cleared	true <sup>11</sup>	
98	Action type	NEWT <sup>12</sup>	
99	Level	PSTN <sup>13</sup>	<pre> &lt;UnqTradldr&gt;PUTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt;  ...   &lt;/Clrd&gt; &lt;/ClrSts&gt; </pre>

<sup>11</sup> Minkejja l-possibbiltà ta' għażla, l-SFTs miftiehma b'mod bilaterali ma jistghux jiġu ssostitwiti minn negozju wieħed, u għalhekk ir-rapporti kollha magħmula bħala livell tal-pożizzjonijiet għandhom jiġu kklirjati.

<sup>12</sup> F'dan l-eżempju tinħoloq pożizzjoni ġdida. Fil-każ li fiha tranżazzjoni kklirjata tkun inkluża f'pożizzjoni eżistenti, din tkun irrapportata bħala modifika ta' dik il-pożizzjoni (bit-tip ta' azzjoni MODI)

<sup>13</sup> Innotta li l-SFT ikklirjata li tirriżulta jenħteġ li tiġi rrapportata fil-livell tal-pożizzjonijiet, u li r-rapportar tal-livell tal-pożizzjonijiet jista' jintuża biss bħala suppliment għar-rapportar fil-livell tan-negozju u għalhekk ir-rapportar tat-Tabelli Tabella 37 u Tabella 38 huwa mistenni.

Tabella 37 - SFT ġdida kklirjata mis-CCP irrapportata fil-livell tal-pożizzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;PSTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.4 Modifika ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet

199. It-Tabella 38 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ li tiġi mmodifikata SFT irrapportata preċedentement fil-livell tat-tranzazzjonijiet.

Tabella 38 - Modifika ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;Mod&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/Mod&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	MODI	
99	Level	TCTN	

#### 5.2.1.5 Modifika ta' SFT ikklirjata mis-CCP fil-livell tal-pożizzjonijiet

200. It-Tabella 39 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' modifika ta' SFT ikklirjata minn CCP li preċedentement kienet irrapportata f'livell tal-pożizzjonijiet. Dan huwa r-riżultat tal-inklużjoni ta' SFTs addizzjonali konklużi fil-livell tat-tranzazzjonijiet u

kklijati fl-istess jum jew f'jum differenti minn CCP. Ma hemm l-ebda possibilità li jiġi mmodifikat ir-rapport oriġinali dwar il-livell tat-tranzazzjonijiet ladarba t-tranzazzjoni tiġi inkluża fil-pożizzjoni, iżda minkejja dan, jekk kwalunkwe informazzjoni tkun ġiet irrapportata ħażin, dik l-SFT tista' tiġi kkoreġuta.

Tabella 39 - Modifika ta' SFT ikklijata mis-CCP fil-livell tal-pożizzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;Mod&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;UnqTradldr&gt;PUTI1&lt;/UnqTradldr&gt;           &lt;ClrSts&gt;             &lt;Clrd&gt;               ...             &lt;/Clrd&gt;           &lt;/ClrSts&gt;         &lt;/RpTrad&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       &lt;LvITp&gt;PSTN&lt;/LvITp&gt;     &lt;/Mod&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	MODI	
99	Level	PSTN	

#### 5.2.1.6 Korrezzjoni ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet

201. It-Tabella 40 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm korrezzjoni ta' kampijiet tad-*data* li ġew ippreżentati ħażin f'rapport preċedenti ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet.

Tabella 40 - Korrezzjoni ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;Crrctn&gt;       ...     &lt;/Crrctn&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	CORR	
99	Level	TCTN	

**Tabella 40 - Korrezzjoni ta' SFT fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;  &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt;  &lt;LvITp&gt;TCTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/Crrctn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.2.1.7 Korrezzjoni ta' SFT ikklirjata mis-CCP fil-livell tal-pożizzjonijiet

202. It-Tabella 41 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm korrezzjoni ta' kampijiet tad-*data* li ġew ippreżentati f'hażin f'rapport preċedenti fil-livell tal-pożizzjonijiet ta' SFT ikklirjata mis-CCP. Ma hemmx bżonn li jiġi kkoreġut ir-rapport originali dwar il-livell tat-tranzazzjonijiet jekk dan ikun ġie rrapportat b'mod korrett.

**Tabella 41 - Korrezzjoni ta' SFT ikklirjata mis-CCP fil-livell tal-pożizzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	PUTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;Crrctn&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;PUTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt; ... &lt;/Clrd&gt; &lt;/ClrSts&gt;  &lt;/RpTrad&gt; </pre>
5	Cleared	true	
98	Action type	CORR	
99	Level	PSTN	

**Tabella 41 - Korrezzjoni ta' SFT ikklirjata mis-CCP fil-livell tal-pożizzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;         ...     &lt;/CollData&gt;     &lt;LvITp&gt;PSTN&lt;/LvITp&gt; &lt;/Crrctn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.8 Valwazzjoni ta' SFT (għal SLB biss)

203. It-Tabella 42 turi l-popolazzjoni ta' kampijiet tar-rapportar meta jkun hemm aġġornament tal-valutazzjoni tat-titoli fi tranżazzjoni SLB. Il-kontroparti tagħti valur ta' 1,000,000 EUR lit-titoli mogħtija b'self li f'dan il-każ jikkoinċidi mal-valur tas-self (Kamp 2.56), li mhuwiex applikabbli għat-Tip ta' azzjoni "VALU". F'dan il-każ, il-valwazzjoni tar-rapport tal-kontroparti tat-titoli mogħtija b'self (Kamp 2.57) fil-munita li fiha jsir is-self. Il-munita tal-valur tas-suq hija indikata fit-tikketta xml.

**Tabella 42 - Valwazzjoni ta' SFT (għal SLB biss)**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;ValtnUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/MktVal&gt;     &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/ValtnUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
57	Market value	1000000	
98	Action type	VALU	

#### 5.2.1.9 Ir-rapportar ta' aġġornament tal-kollateral għal SFTs kollateralizzati fil-livell tat-tranżazzjonijiet

204. Ir-rapportar ta' kwalunkwe informazzjoni dwar il-kollateral jenħtieġ li jsir biss bit-tip ta' azzjoni COLU u, għal SFTs ikkollateralizzati fil-livell tat-tranżazzjonijiet, jenħtieġ li l-UTI

tat-tranzazzjoni kollateralizzata jiġi rrapportat ukoll kif muri fit-Tabella 43. L-ispeċifitàjiet tar-rapportar tal-kollateral huma koperti fit-Taqsima 5.4.

205. Dan l-eżempju jista' jiġi applikat ukoll għar-rapportar ta' kollateral għal SFTs irrapportati fil-livell tal-pożizzjonijiet, fil-każ fejn il-kollateral ikun assenjat lill-pożizzjoni.

Tabella 43 - Ir-rapportar ta' aġġornament tal-kollateral għal SFTs kollateralizzati fil-livell tat-tranzazzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/CollUpd&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		

206. Barra minn hekk, ladarba SFT tiġi inkluża f'pożizzjoni, kwalunkwe aġġornament tal-kollateral jenħtieġ li jiġi rrapportat għal dik il-pożizzjoni minflok għal SFT oriġinali.

#### 5.2.1.10 Ir-rapportar ta' aġġornament tal-kollateral għal SFTs kollateralizzati fil-livell tal-iskoperturi netti

207. Ir-rapportar ta' kwalunkwe informazzjoni dwar kollateral jenħtieġ li jitwettaq biss bit-Tip ta' azzjoni COLU u, għal SFTs ikkollateralizzati fil-livell tal-iskoperturi netti, ma huwa meħtieġ l-ebda UTI kif muri fit-Tabella 44. L-ispeċifitàjiet tar-rapportar tal-kollateral huma koperti fit-Taqsima 5.4.

Tabella 44 - Ir-rapportar ta' aġġornament tal-kollateral għal SFTs kollateralizzati fil-livell tal-iskoperturi netti			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)		<pre> &lt; SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;       ... </pre>
98	Action type	COLU	
99	Level		



**Tabella 44 - Ir-rapportar ta' aġġornament tal-kollateral għal SFTs kollateralizzati fil-livell tal-iskoperturi netti**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/TradData&gt; ... &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.2.1.11 Terminazzjoni bikrija ta' SFT

208. It-Tabella 45 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar meta ssejtn it-terminazzjoni ta' SFT b'terminu miftuħ jew terminazzjoni bikrija ta' SFT b'terminu fiss. Il-livell, jiġifieri t-tranzazzjoni jew il-pożizzjoni, li fih tiġi rrapportata l-SFT huwa irrilevanti għal dan il-każ ta' użu, peress li l-Kamp 2.99 "Livell" mhuwiex applikabbli għal dan it-tip ta' azzjoni.

**Tabella 45 - Terminazzjoni bikrija ta' SFT**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;EarlyTermntn&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/EarlyTermntn&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	ETRM	
99	Level		

#### 5.2.1.12 Żbalji f'SFT

209. It-Tabella 46 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar f'każ ta' kancellazzjoni ta' rapport sħiħ sottomess ħażin fejn l-SFT qatt ma tkun sejtnet jew ma kinitx soġġetta għal obbligi ta' rapportar tal-SFTs, iżda li tkun ġiet irrapportata lil TR bi żball. Il-livell, jiġifieri t-

tranżazzjoni jew il-pożizzjoni, li fiha tiġi rrapportata l-SFT huwa irrilevanti għal dan il-każ ta' użu, peress li l-Kamp 2.99 "Livell" mhuwiex applikabbli għal dan it-tip ta' azzjoni.

Tabella 46 - Żbalji f'SFTs fil-livell tat-tranżazzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;Err&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/Err&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	EROR	
99	Level		

### 5.3 Data dwar is-Self

210. It-taqsimiet sussegwenti jenfasizzaw il-popolazzjoni ta' sett partikolari ta' kampijiet li għandhom karatteristiċi speċifiċi komuni tal-parti tas-self ta' tranżazzjoni. Dawn se jippermettu biex il-kontropartijiet li jirrapportaw jivvalutaw direttament l-informazzjoni li jenħtieġ li jirrapportaw għal kull taqsima tad-*data* speċifika fejn applikabbli.
211. Ir-regoli dwar il-validazzjoni jinkludu l-gwida kompluta dwar il-kampijiet applikabbli għal kull tip ta' SFT, Tip ta' azzjoni u Livell, kif ukoll id-dipendenzi rilevanti.
212. L-eżempji u l-każijiet ta' użu kollha ta' hawn taft fihom kodiċijiet iġġenerati b'mod aleatorju, filwaqt li l-ebda wieħed minnhom ma jappartjeni għal titolu jew għal entità.

#### 5.3.1 Rapportar tad-*data* dwar l-avveniment

213. Il-kontropartijiet jenħtieġ li jkunu konxji li l-informazzjoni rrapportata fir-rigward ta' *data* dwar avveniment partikolari jenħtieġ li tippermetti lill-awtoritajiet jieħdu stampa ċara tal-iskoperturi li jirriżultaw minn (sett ta') SFTs partikolari sa mill-għeluq tal-jum li għalih tirreferi l-SFT. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw id-*data* dwar l-avveniment f'konformità mat-taqsimi 4.9.6.

## 5.3.2 Rapportar ta' SFT ikklirjata/mhux ikklirjata

### 5.3.2.1 Offerta miftuħa ta' SFTs ikklirjati

214. Meta negozju jkun ikklirjat f'mudell ta' offerta miftuħa, l-ikklirjar iseħħ fil-hin tal-konklużjoni tal-SFT.
215. It-Tabella 47 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tas-sitwazzjoni msemmija hawn fuq mill-perspettiva ta' CCP O u ta' CM-klijent, peress li f'dan il-każ hija identika.
216. Jenħtiegħ li jiġi rrapportat il-grupp li ġej ta' kampijiet tar-rapportar:
- "Ikklirjata" (Kamp 2.5) timtela b"veru";
  - "Kronogramma tal-Ikklirjar" (Kamp 2.6) hija l-istess għall-Kamp 2.12 "Kronogramma ta' eżekuzzjoni";
  - "CCP" (Kamp 2.7) timtela bl-LEI tas-CCP O.

Tabella 47 - Mill-perspettiva tas-CCP u tas-CM			
No	Field	Example	XML Message
2	Report tracking number	RTN1	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;           &lt;ClrSts&gt;             &lt;Clrd&gt;               &lt;CCP&gt;                 &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt;               &lt;/CCP&gt;               &lt;ClrDtTm&gt;2020-04- 2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt;             &lt;/Clrd&gt;           &lt;/ClrSts&gt;           &lt;MstrAgrmt&gt;             &lt;Tp&gt;               &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;             &lt;/Tp&gt;           &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCPClearingCondition s&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;           &lt;/MstrAgrmt&gt;         &lt;/RpTrad&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt; </pre>
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	

Tabella 47 - Mill-perspettiva tas-CCP u tas-CM			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.2.2 SFT ikklirjata f'mudell ta' novazzjoni

217. Meta negozju jkun ikklerjat f'mudell ta' novazzjoni, l-ikklijar iseħħ wara l-hin tal-konkluzjoni tal-SFT.
218. It-Tabella 48 u Tabella 49 juru l-popolazzjoni tal-kampijiet, mill-perspettiva ta' CCP O u ta' CM rispettivament, f'każ ta' SFT ikklirjata minn CCP O f'mudell ta' novazzjoni.
219. F'dan ir-rigward, jenħtieg li jiġi rrapportat il-grupp li ġej ta' kampijiet tar-rapportar:
- In-“numru ta' traċċar tar-rapport” (Kamp 2.2) jenħtieg li jiġi rrapportat bil-UTI preċedenti (dak tat-tranzazzjoni bilaterali fil-każ ta' SFTs ikklirjati minn CCP) iżda għandu jiġi rrapportat biss mis-CM u mill-klijent tiegħu (mhux mis-CCP);
  - “Ikklijata” (Kamp 2.5) timtela b“veru”;
  - “Kronogramma tal-Ikklijar” (Kamp 2.6) hija wara l-Kamp 2.12 Kronogramma ta' eżekuzzjoni;
  - “CCP” (Kamp 2.7) timtela bi-LEI tas-CCP O.

Tabella 48 – SFT ikklirjata f'mudell ta' novazzjoni mill-perspettiva tas-CCP			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt; &lt;CCP&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/CCP&gt; </pre>
2	Report tracking number		
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

**Tabella 48 – SFT ikklirjata f’modell ta’ novazzjoni mill-perspettiva tas-CCP**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;ClrDtTm&gt;2020-04- 22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt; &lt;/Clrd&gt; &lt;/ClrSts&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;CCPClearingCondition s&lt;/OthrMstrAgrmtDtIs&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;  &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

220. It-Tabella 49 turi l-eżempju mill-perspettiva tas-CM. Il-popolazzjoni tal-kampijiet jenħtieġ li tkun l-istess għall-perspettiva tal-klijent.

**Tabella 49 - SFT ikklirjata f’modell ta’ novazzjoni mill-perspettiva tas-CM**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2&lt;/UnqTradIdr&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04- 22T14:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ClrSts&gt; &lt;Clrd&gt; &lt;CCP&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBB1111111111&lt;/LEI&gt; &lt;/CCP&gt; &lt;ClrDtTm&gt;2020-04- 22T16:41:07Z&lt;/ClrDtTm&gt; </pre>
2	Report tracking number	UTI1	
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	

**Tabella 49 - SFT ikklirjata f'mudell ta' novazzjoni mill-perspettiva tas-CM**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;RptTrckgNb&gt;UT11&lt;/RptTrckgNb&gt;   &lt;/Clrd&gt;   &lt;/ClrSts&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;    &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCPClearingConditions&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;     &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;                                  &lt;CollData&gt;                                 ...                                 &lt;/CollData&gt;                                 ...    &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.2.3 SFT ikklirjata mis-CCP f'mudell DBV

221. Meta negozju jkun ikklirjat f'mudell DBV, l-ikklijar iseñh wara l-hin tal-konklużjoni tal-SFT.
222. Il-Kamp 2.19 tindika jekk it-tranzazzjoni ġietx saldata bl-użu tal-mekkaniżmu ta' Konsenja skont il-Valur.
223. It-Tabella 50 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet mill-perspettiva tas-CCP O. F'dan ir-rigward, jenħtieġ li jiġi rrapportat il-grupp li ġej ta' kampijiet tar-rapportar:
- "Ikklijata" (Kamp 2.5) timtela b"veru";
  - "Kronogramma tal-Ikklijar" (Kamp 2.6) hija wara l-Kamp 2.12 Kronogramma ta' eżekuzzjoni;
  - "CCP" (Kamp 2.7) timtela bl-LEI tas-CCP O.

**Tabella 50 - Perspettiva tas-CCP**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UT12	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;                                  ...                                 &lt;CtrPtyData&gt;                                 ...                                 &lt;/CtrPtyData&gt; </pre>
2	Report tracking number		
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	

Tabella 50 - Prospettiva tas-CCP			
No	Field	Example	XML Message
7	CCP	{LEI} of CCP O	<LnData> <RpTrad> <UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04- 22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP>
9	Master agreement Type	OTHR	
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	
12	Execution timestamp	2020-04- 22T14:41:07Z	
19	Delivery by Value ("DBV") indicator	true	<LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04- 22T16:41:07Z</ClrDtTm> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp> <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingCondition s</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>

Tabella 51 - Prospettiva tas-CM			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI2	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New> <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> ... <LnData> <RpTrad>
2	Report tracking number	UTI1	
5	Cleared	true	
6	Clearing timestamp	2020-04- 22T16:41:07Z	
7	CCP	{LEI} of CCP O	
9	Master agreement Type	OTHR	

Tabella 51 - Prospettiva tas-CM			
No	Field	Example	XML Message
10	Other master agreement type	CCPClearing Conditions	<UnqTradIdr>UTI2</UnqTradIdr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> <ClrSts> <Clrd> <CCP>  <LEI>BBBBBBBBBB1111111111</LEI> </CCP> <ClrDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</ClrDtTm>  <RptTrckgNb>UTI1</RptTrckgNb> </Clrd> </ClrSts> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>OTHR</Tp> </Tp>  <OthrMstrAgrmtDtIs>CCPClearingConditions</OthrMstrAgrmtDtIs> </MstrAgrmt> <DlvryByVal>true</DlvryByVal> </RpTrad> </LnData>  <CollData> ... </CollData> ...  </New> </Rpt> </TradData> </SciesFincgRptgTxRpt>
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	
19	Delivery by Value (“DBV”) indicator	true	

#### 5.3.2.4 SFT mhux ikklirjati

224. “Ikklirjata” (Kamp 2.5) jigi ppoplat b’falz” kif muri fit-Tabella 52. Il-bqija tal-kampijiet relatati mal-ikklerjar mhijiex ippopolata. Il-kronogramma tal-eżekuzzjoni hija ppopolata.

Tabella 52 - SFT mhux ikklirjati			
No	Field	Example	XML Message
1	Unique Trade Identifier (UTI)	UTI1	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt>
2	Report tracking number		
5	Cleared	false	



Tabella 52 - SFT mhux ikklirjati			
No	Field	Example	XML Message
6	Clearing timestamp		<New>
7	CCP		<CtrPtyData> ...
12	Execution timestamp	2020-04-22T14:41:07Z	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr> <ExctnDtTm>2020-04-22T14:41:07Z</ExctnDtTm> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.3 Ċentru tan-negozjar

225. Il-kamp “Ċentru tan-negozjar” (Kamp 2.8) jenħtieg li tiġi ppopolata skont it-tip ta’ konkluzjoni tal-SFT. Jenħtieg li l-kontropartijiet dejjem jużaw is-segment MIC.
226. F’każ li SFT tiġi konkluzja f’sistema ta’ negozjar awtomatizzat (ATS) jew pjattaforma ta’ tlaqqiġ tas-sensara finanzjarji, jenħtieg li l-MIC tal-pjattaforma jiġi ppopolat. Dan il-kamp ma jippermettix il-popolazzjoni bl-LEI.

### 5.3.4 Taqsima tal-ftehim prinċipali

#### 5.3.4.1 SFT iddokumentata bi ftehim prinċipali mil-lista

227. Meta jintuża ftehim prinċipali, jenħtieg li jiġu rrapportati l-kampijiet li ġejjin:
- “Tip ta’ ftehim prinċipali” (Kamp 2.9);
  - “Verżjoni ta’ ftehim prinċipali” (Kamp 2.11), meta l-Kamp 2.9 ikun ippopolat b’valur għajr “BIAG”. “CSDA” jew “OTHR”.
228. Jekk il-ftehim prinċipali (għajr “BIAG”, “CSDA” jew “OTHR”) ma jkollux verżjoni, jenħtieg li l-kontropartijiet jippopolaw il-kaxxa “Verżjoni tal-ftehim prinċipali” bis-sena li fiha ffirmaw il-ftehim.
229. L-SFTs taħt il-programmi fails-curing tas-CSDs jenħtieg li jiġu rrapportati bit-Tip ta’ ftehim prinċipali “CSDA”.
230. It-Tabella 53 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f’każ li l-SFT tiġi konkluzja skont il-ftehim prinċipali tal-GMRA 2011.

Tabella 53 - SFT iddokumentata bi ftehim prinċipali mil-lista			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	GMRA	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;MstrAgrmt&gt;             &lt;Tp&gt;               &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;             &lt;/Tp&gt;             &lt;Vrsn&gt;2011&lt;/Vrsn&gt;           &lt;/MstrAgrmt&gt;         &lt;/RpTrad&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
10	Other master agreement type		
11	Master agreement version	2011	

#### 5.3.4.2 SFT iddokumentata bi ftehim li mhuwiex fil-lista

231. Meta ftehim prinċipali li ma jkunx fil-lista (eż. il-kundizzjonijiet tal-ikklijar tas-CCP għal tranżazzjonijiet novati, jew ta' ftehimiet bilaterali ta' senserija prima f'self b'marġni) jintuża dawn il-kampijiet li ġejjin jenħtieġ li jiġu rrapportati:
- “Tip ta' ftehim prinċipali” (Kamp 2.9).
  - “Tip ta' ftehim prinċipali ieħor” (Kamp 2.10), meta tiġi rrapportata “OTHR” fil-Kamp 2.9.
232. It-Tabella 54 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-SFT tiġi konkluża taht ftehim prinċipali li ma jkunx fil-lista u tirreferi għall-Ġabra ta' Regoli dwar ic CCP O Repo

Tabella 54 - SFT iddokumentata bi ftehim li mhuwiex fil-lista			
No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       &lt;LnData&gt;         ... </pre>
10	Other master agreement type	CCP O Repo Rulebook	
11	Master agreement version		

**Tabella 54 - SFT iddokumentata bi ftehim li mhuwiex fil-lista**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;RpTrad&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;     &lt;OthrMstrAgrmtDtls&gt;CCP O Repo Rulebook&lt;/OthrMstrAgrmtDtls&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       ...       &lt;/CollData&gt;       ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.4.3 SFT mhux iddokumentata

233. Fil-każ ta' SFT mhux iddokumentata, jenħtieġ li jiġu rrapportati l-kampijiet li ġejjin (ara t-Tabella 55):

- “Tip ta’ ftehim prinċipali” (Kamp 2.9), li jenħtieġ li jiġi ppopolat b’“OTHR”.
- “Tip ta’ ftehim prinċipali ieħor” (Kamp 2.10), li jenħtieġ li jiġi ppopolat b’“Mhux iddokumentata”.

**Tabella 55 - SFT mhux iddokumentata**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement type	OTHR	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt; </pre>
10	Other master agreement type	Undocumented	
11	Master agreement version		

**Tabella 55 - SFT mhux iddokumentata**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;OthrMstrAgrmtDtIs&gt;Undocumented&lt;/Oth rMstrAgrmtDtIs&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;                                 &lt;CollData&gt;                                 ...                                 &lt;/CollData&gt;                                 ...   &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.5 Konkluzjoni u bidu tat-tranzazzjoni

234. Iż-żewġ eżempji li ġejjin juru r-rapportar ta' konkluzjoni tal-SFT (a) li tibda immedjatament u (b) b'data ta' valur bil-quddiem.
235. Id-data tal-valur jenħtieġ li tintfiehema b'hala d-data tas-saldu miftiehema skont id-definizzjoni tal-Kamp 2.13 fl-RTS. Falliment temporanju tas-saldu fid-Data tal-valur mistennija ma jkunx jeħtieġ rapport addizzjonali (eż. "Modifika"), sakemm il-kontropartijiet ma jaqblux li jemendaw jew itemmu t-tranzazzjoni minħabba l-falliment tas-saldu (f'liema każ il-modifika jew l-avveniment ta' terminazzjoni jeħtieġ li jiġi rrapportat kif xieraq).

#### 5.3.5.1 Immedjata

236. It-Tabella 56 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li t-tranzazzjoni tiġi eżegwita u tibda f'jumejn, jiġifieri ċ-ċiklu tas-saldu fl-UE. Din hija SFT immedjata.

**Tabella 56 - Immedjata**

No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;                                 ...                                 &lt;CtrPtyData&gt;                                 ...   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt;   &lt;ValDt&gt;2020-04-24&lt;/ValDt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;                                 &lt;CollData&gt; </pre>
13	Value date (Start date)	2020-04-24	

Tabella 56 - Immedjata			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.5.2 Bil-quddiem

237. It-Tabella 57 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li t-tranzazzjoni tibda xahar wara li tiġi eżegwita; dan ifisser li din hija SFT bil-quddiem.

Tabella 57 - Bil-quddiem			
No	Field	Example	XML Message
12	Execution timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;ExctnDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/ExctnDtTm&gt; &lt;ValDt&gt;2020-05-22&lt;/ValDt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
13	Value date (Start date)	2020-05-22	

### 5.3.6 Termini tal-SFT

238. Meta jirrapportaw il-Perjodu minimu ta' notifika (Kamp 2.16), jenħtieġ li l-kontropartijiet jipprovdu l-informazzjoni dwar il-jiem ta' negozju f'konformità mad-definizzjoni ta' jum ta' negozju fil-ftehim prinċipali rilevanti jew fi ftehim bilaterali li jirregola l-SFT.

239. Meta dan il-kamp ikun applikabbli għal SFTs li l-opzjonalità tagħhom ma tkunx inkluża fit-TS dwar ir-rapportar, bħal repos puttable, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw l-informazzjoni dwar id-Data tal-eqreb sejha lura (Kamp 2.17) jekk tkun disponibbli.

240. Jenħtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw il-Perjodu minimu ta' notifika (Kamp 2.16) għal repos b'terminu miftuħ jiġifieri l-Kamp 2.21 jimtela b'"veru", kif ukoll għal repos kontinwi u estendibbli, jiġifieri l-Kamp 2.22 jimtela b'ETSB u b'EGRN.
241. Jenħtieg li l-kontropartijiet jippopolaw il-Kamp 2.17 "Data tal-eqreb sejha lura-" għal dawk l-SFTs li għandhom l-ghazla tat-terminazzjoni. Sakemm il-kontropartijiet ma jkunux qablu li jkollhom data tal-eqreb sejha lura ġdida, jenħtieg li huma jirrapportaw id-data tal-eqreb sejha lura originali applikabbli għall-SFT.

#### 5.3.6.1 Terminu miftuħ

242. It-Tabella 58 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-kontropartijiet jaqblu dwar tranżazzjoni b'terminu miftuħ b'perjodu minimu ta' notifika għat-terminazzjoni tat-tranżazzjoni ta' jum wiehed (1).

Tabella 58 - Terminu miftuħ			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)		<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
16	Minimum notice period	1	<Rpt> <New>
17	Earliest call-back date		... <CtrPtyData>
21	Open term	true	... </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <MinNtcePrd>1</MinNtcePrd> <Term> <Opn>NOAP</Opn> </Term> </RpTrad> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.3.6.2 Terminu fiss

243. It-Tabella 59 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-kontropartijiet jaqblu li jiskambjaw flus kontanti, titoli, jew komoditajiet kontra kollateral għall-komponent tal-għeluq (komponent bil-quddiem) tal-SFT fit-22 ta' Mejju 2020.
244. In-numru minimu ta' jiem ta' negozju, fl-eżempju, li waħda mill-kontropartijiet trid tinforma lill-kontroparti l-oħra dwar it-terminazzjoni ta' din l-SFT huwa 5.

245. L-eqreb data li fiha s-sellief tal-flus ikollu d-dritt li jsejjaħ lura parti mill-fondi jew li jtemm it-tranzazzjoni hija s-7 ta' Mejju 2020. Filwaqt li dan ix-xenarju mhuwiex prattika standard, xorta għadu possibbli li sseħħ.

Tabella 59 - Termini fiss			
No	Field	Example	XML Message
14	Maturity date (End date)	2020-05-22	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;MinNtcePrd&gt;5&lt;/MinNtcePrd&gt;             &lt;EarlstCallBckDt&gt;2020-05- 07&lt;/EarlstCallBckDt&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;       &lt;/New&gt;       &lt;Mod&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;Term&gt;               &lt;Fxd&gt;                 &lt;MtrtyDt&gt;2020-05- 22&lt;/MtrtyDt&gt;               &lt;/Fxd&gt;             &lt;/Term&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/Mod&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
16	Minimum notice period	5	
17	Earliest call-back date	2020-05-07	
21	Open term	false	

### 5.3.7 Ghazla -tat-terminazzjoni

246. L-ESMA tirrimarka li jenħtiegħ li l-kontropartijiet jirrapportaw il-Kamp 2.22 b'wieħed mill-valuri li ġejjin: "EGRN", "ETSB" jew "NOAP". Il-kamp 2.21 għandu jkun fih wieħed mill-valuri: "veru" jew "falz". Jekk il-Kamp 2.22 Ghazla ta' terminazzjoni jiġi ppopolat b'"ETSB", dan il-kamp għandu jiġi ppopolat b'"falz".

247. F'każ li l-SFT tkun eżerċitabbli jew puttable, il-kontropartijiet jenħtiegħ li jirrapportaw din l-informazzjoni f'"Data tal-eqreb sejha lura" (Kamp 2.17).

### 5.3.8 Arrangamenti ġenerali u speċifiċi tal-kollateral

248. Il-kamp “Indikatur Ġenerali tal-Kollateral” (Kamp 2.18) japplika biss għat-titoli pprovduti bħala kollateral, u mhux għat-titoli fuq is-self.
249. F’konformità mal-RTS, u għal konsistenza mal-istruzzjonijiet ta’ rapportar fl-MMSR, jenħtieġ li tiġi rrapportata “GENE” fil-każijiet kollha li fihom il-fornitur tal-kollateral ikun jista’ jagħzel it-titolu li jipprovdi bħala kollateral fost firxa ta’ titoli li jissodisfaw kriterji predefiniti. Dan jinkludi wkoll, iżda mhux limitat għal, faċilitajiet tal-GC ipprovduti minn Sistema Awtomatika ta’ Negozjar bħal dawk immexxija minn CCPs, u tranżazzjonijiet li fihom il-kollateral ikun ġestit minn aġent tripartitiku. Jenħtieġ li “GENE” tkun ukoll il-każ predefinit fil-biċċa l-kbira tal-arrangamenti tal-SLB. “SPEC” jenħtieġ li tiġi rrapportata biss f’każijiet li fihom ir-riċevitur tal-kollateral jitlob li jiġi pprovdut ISIN speċifiku bħala kollateral.
250. Ir-rapportar tal-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta’ skopertura netta (Kamp 2.73) huwa kwistjoni separata, li mhijiex marbuta direttament mat-tip ta’ arrangament tal-kollateral. Tranżazzjonijiet li jsiru fuq pjattaforma tal-GC jistgħu jiġu kollateralizzati jew fuq bażi ta’ tranżazzjoni waħda jew fuq bażi ta’ skopertura netta. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportawhom kif xieraq. Ir-rapportar ta’ basktijiet ta’ kollateral huwa spjegat fit-Taqsima 5.4.2 dwar il-kollateralizzazzjoni.
251. Meta SFT kienet oriġinarjament tkun ġiet konkluzja bħala GC, iżda jkollha titoli speċifiċi magħżula mir-riċevitur tal-kollateral allokati wara l-eżekuzzjoni, din issir tranżazzjoni speċifika ta’ kollateral immedjatament. Rapport ta’ SFT bit-tip ta’ azzjoni “MODI” jenħtieġ li jiġi rrapportat bil-valur rivedut għall-Kamp 2.18, u l-kollateral rilevanti jenħtieġ li jiġi rrapportat bit-tip ta’ azzjoni “COLU”.
252. Sakemm ma jkunx miftiehem mod ieħor mill-kontropartijiet, ir-repos tripartitiċi jenħtieġ li jiġu rrapportati bil-Kamp 2.18 “Indikatur tal-kollateral ġenerali” ppopolat bħala “GENE”.
253. It-Tabella 60, it-Tabella 61 u t-Tabella 62 jipprovdu tliet eżempji ta’ kif għandu jiġi ppopolat l-“Indikatur tal-Kollateral Ġenerali” (Kamp 2.18). Jekk jogħġbok kun af li dawn jistgħu ma jkoprox il-każijiet eżistenti kollha.

#### 5.3.8.1 Kollateral speċifiku fit-trasferiment ta’ titlu

254. It-Tabella 60 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f’każ li l-SFT tkun soġġetta għal arrangament speċifiku tal-kollateral (Kamp 2.18 ippopolati b’SPEC), u tali kollateral ikun soġġett għal trasferiment ta’ titlu (Kamp 2.20 ippopolati b’TTCA).

Tabella 60 - Kollateral speċifiku fit-trasferiment ta’ titlu			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	SPEC	<SciesFincgRptgTxRpt> <TradData>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	<Rpt> <New>
20	Method used to provide collateral	TTCA	... <CtrPtyData> ... </CtrPtyData> <LnData>



**Tabella 60 - Kollateral speċifiku fit-trasferiment ta' titlu**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;RpTrad&gt;   &lt;GnlColl&gt;SPEC&lt;/GnlColl&gt;   &lt;DlvryByVal&gt;&gt;false&lt;/DlvryByVal&gt;  &lt;CollDlvryMtd&gt;TTCA&lt;/CollDlvryMtd&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt;    &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.8.2 Kollateral ġenerali f'rahan

255. It-Tabella 61 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-SFT tkun soġġetta għal arranġament ġenerali tal-kollateral (Kamp 2.18 ippopolati b'GENE), u tali kollateral ikun soġġett għal Arranġament tal-kollateral finanzjarju tat-titoli (Kamp 2.20) ippopolat b'SICA.

**Tabella 61 - Kollateral ġenerali f'rahan**

No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;     &lt;GnlColl&gt;GENE&lt;/GnlColl&gt;     &lt;DlvryByVal&gt;&gt;false&lt;/DlvryByVal&gt;   &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	false	
20	Method used to provide collateral	SICA	

### 5.3.8.3 Kollateral ġenerali DBV fi trasferiment ta' titlu

256. It-Tabella 62 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-SFT tkun soġġetta għal arranġament ġenerali tal-kollateral (Kamp 2.18 ippopolati b'GENE), u tali kollateral ikun soġġett għal trasferiment ta' titlu (Kamp 2.20 ippopolat b'TTCA). It-tranzazzjoni tiġi saldata bl-użu tal-mekkaniżmu DBV (Kamp 2.19) ippopolat b'VERU.

Tabella 62 - Kollateral ġenerali DBV fi trasferiment ta' titlu			
No	Field	Example	XML Message
18	General collateral indicator	GENE	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;GnlColl&gt;GENE&lt;/GnlColl&gt; &lt;DivryByVal&gt;true&lt;/DivryByVal&gt; </pre>
19	Delivery By Value ('DBV') indicator	true	
20	Method used to provide collateral	TTCA	

### 5.3.9 Rati fissi jew varjabbli

257. Meta jikkonkludu SFTs, il-kontropartijiet jistgħu jaqblu li jużaw rata tal-imgħax fissa jew rata varjabbli għan-naħa tas-self tal-SFT. Valuri negattivi huma permessi għar-“Rata fissa” (Kamp 2.23) u għar-“Rata varjabbli aġġustata” (Kamp 2.35).
258. Meta jirrapportaw rati varjabbli, jenħtieġ li l-kontropartijiet jindikaw ir-rata rilevanti u l-firxa applikabbli. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jaġġornaw din l-informazzjoni biss meta jaqblu li jibdlu r-rata jew il-firxa, iżda mhux fuq bażi ta' kuljum.
259. Ċerti rati varjabbli, bħall-ESTER, l-SOFR, eċċ., ġew stabbiliti wara l-pubblikazzjoni tal-RTS u tal-ITS dwar ir-rapportar. Għandhom kodiċi ISO. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jużaw il-kodiċijiet diġà maqbula biex jirrapportaw l-informazzjoni b'mod aktar konsistenti. Meta jkun hemm rati varjabbli oħra li ma għandhomx kodiċi ISO, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw kodiċi alfanumeriku konsistenti.
260. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw il-Kampijiet 2.35 “Rata aġġustata” u 2.36 “Data tar-rata” biss għal tibdiliet fir-rata futuri miftiehma minn qabel koperti bħala parti mill-

konklużjoni tat-tranzazzjoni. Jenħtiegħ li l-bqija tat-tibdiliet għar-rati fissi jew varjabbli tiġi rrapportata fil-Kampijiet 2.23 u 2.25, rispettivament.

261. Jenħtiegħ li l-kontropartijiet ma jirrapportawx fil-Kampijiet 2.23 jew 2.25 kwalunkwe rata relatata mal-valur qasir tas-suq (Kamp 2.71).

#### 5.3.9.1 Rata fissa - Rapport inizjali

262. Meta l-kontropartijiet jikkonkludu SFTs b'rati fissi, jenħtiegħ li huma jippopolaw il-Kampijiet 2.23 u 2.24 kif muri fit-Tabella 63. F'dan il-każ, ir-rata tal-imgħax annwalizzata hija "-0.23455" bil-konvenzjoni tal-għadd tal-granet bħala Actual360 ("A004").

Tabella 63 - Rata fissa - Rapport inizjali			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;UnqTradIdr&gt;UTI1&lt;/UnqTradIdr&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;IntrstRate&gt;               &lt;Fxd&gt;                 &lt;Rate&gt;-0.23455&lt;/Rate&gt;                 &lt;DayCntBsis&gt;                   &lt;Cd&gt;A004&lt;/Cd&gt;                 &lt;/DayCntBsis&gt;               &lt;/Fxd&gt;             &lt;/IntrstRate&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
23	Fixed rate	-0.23455	
24	Day count convention	A004	
98	Action type	NEWT	

#### 5.3.9.2 Rata fissa – modifika

263. Meta l-kontropartijiet jaqblu li jimmodifikaw ir-rata fissa, jiġifieri li jikklassifikaw mill-ġdid l-SFT, jenħtiegħ li huma jirrapportaw il-modifika fil-Kamp 2.23 u fil-Kamp 2.24, kif muri fit-Tabella 64. F'dan il-każ, ir-rata tal-imgħax annwalizzata l-ġdida tkun ta' "0.12345" bil-konvenzjoni l-ġdida tal-għadd ta' jiem bħala Actual365Fixed ("A005").

Tabella 64 - Rata fissa – modifika			
No	Field	Example	XML Message
1	UTI	UTI1	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;Mod&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;&lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;             &lt;IntrstRate&gt;               &lt;Fxd&gt;                 &lt;Rate&gt;0.12345&lt;/Rate&gt;                 &lt;DayCntBsis&gt;                   &lt;Cd&gt;A005&lt;/Cd&gt;                 &lt;/DayCntBsis&gt;               &lt;/Fxd&gt;             &lt;/IntrstRate&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/Mod&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
23	Fixed rate	0.12345	
24	Day count convention	A005	
98	Action type	MODI	

### 5.3.9.3 Rata varjabbli – Rapport inizjali

264. Fit-Tabella 65 tintwera l-popolazzjoni tal-kampijiet meta l-kontropartijiet ikunu kkonkludew SFT billi jagħzlu bħala rata ta' referenza EONIA (Kamp 25) b'perjodu ta' referenza tar-rata varjabbli espress f'jiem (Kamp 2.26) b'numru sħiħ multiplikatur tal-perjodu ta' żmien ta' jum wieħed (1) (Kamp 2.27).
265. Il-kontropartijiet qablu wkoll fuq perjodu ta' żmien ta' ġimgħa fil-frekwenza tal-pagamenti b'rata varjabbli (Kamp 2.28) b'numru sħiħ multiplikatur tal-perjodu ta' żmien ta' ġimgħa waħda (1) (Kamp 2.29) li jiddeskrivi kemm spiss il-kontropartijiet jiskambjaw pagamenti.
266. F'dan il-każ, ir-rata varjabbli ttrisetta b'perjodu ta' żmien ta' jiem (Kamp 2.30) b'multiplikatur ta' jum wieħed (1) (Kamp 2.31).
267. F'dan il-każ, in-numru ta' punti bażi li għandhom jiżdiedu (jew jitnaqqsu fil-każ ta' valur negattiv li huwa permess għal dan il-kamp) bħala firxa għar-rata tal-imgħax varjabbli sabiex tiġi ddeterminata r-rata tal-imgħax huwa "5" (Kamp 2.32).

Tabella 65 - Rata varjabbli – Rapport inizjali			
No	Field	Example	XML Message
25	Floating rate	EONA	<SctiesFincgRptgTxRpt>
26	Floating rate reference period - time period	DAYS	<TradData>
27	Floating rate reference period - multiplier	1	<Rpt>
28	Floating rate payment frequency - time period	WEEK	<New>
29	Floating rate payment frequency - multiplier	1	...
30	Floating rate reset frequency - time period	DAYS	<CtrPtyData>
31	Floating rate reset frequency - multiplier	1	...
32	Spread	5	</CtrPtyData>
			<LnData>
			<RpTrad>
			<IntrstRate>
			<Fltg>
			<RefRate>
			<Indx>EONA</Indx>
			</RefRate>
			<Term>
			<Unit>DAYS</Unit>
			<Val>1</Val>
			</Term>
			<PmtFrqcy>
			<Unit>WEEK</Unit>
			<Val>1</Val>
			</PmtFrqcy>
			<RstFrqcy>
			<Unit>DAYS</Unit>
			<Val>1</Val>
			</RstFrqcy>
			<BsisPtSprd>5</BsisPtSprd>
			</Fltg>
			</IntrstRate>
			</RpTrad>
			</LnData>
			<CollData>
			...
			</CollData>
			...
			</New>
			</Rpt>
			</TradData>
			</SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.3.9.4 Kampijiet tal-aġġustament tar-rata varjabbli

268. L-aġġustament tar-rata varjabbli jenħtieġ li jiġi rrapportat kif kien miftiehem mill-kontropartijiet. Valuri negattivi huma permessi.

### 5.3.10 Ammonti prinċipali ta' repo u ta' BSB/SBB

269. It-Tabella 66 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ li l-ammont prinċipali fid-data tal-valur huwa ta' EUR 10,162,756.90, u l-ammont prinċipali fid-data ta' maturità huwa ta' EUR 10,161,551.48.
270. Meta l-ammont prinċipali fil-valur tad-data tal-maturità (Kamp 2.38) ma jkunx għadu magħruf, ir-regoli dwar il-validazzjoni jippermettu li dan il-kamp jiġihalla vojta. Jenħtieġ li aktar tard dan il-kamp jiġi aġġornat meta l-valur ikun magħruf.
271. Fil-każ ta' parametri referenzjarji, l-ammont prinċipali mistenni fid-data ta' maturità jenħtieġ li jiġi rrapportat fil-ħin tar-rapportar u aġġornat ladarba tkun magħrufa l-varjanza.

Tabella 66 - Ammonti prinċipali ta' repo u ta' BSB/SBB			
No	Field	Example	XML Message
37	Principal amount on the value date	10162756.90	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;PrncplAmt&gt;               &lt;ValDtAmt                 Ccy="EUR"&gt;10162756.9&lt;/ValDtAmt&gt;               &lt;MtrtyDtAmt                 Ccy="EUR"&gt;10161551.48&lt;/MtrtyDtAmt&gt;             &lt;/PrncplAmt&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             ...           &lt;/CollData&gt;           ...         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
38	Principal amount on the maturity date	10161551.48	
39	Principal amount currency	EUR	

### 5.3.11 Naħa tas-self f'self ta' titoli

272. Fi tranżazzjonijiet SLB, in-naħa tas-self tan-negozju tinvolvi titolu li jrid ikun ivvalutat b'mod konsistenti mill-kontropartijiet li jirrapportaw. Il-“Prezz tat-titolu jew tal-komodità” (Kamp 2.49) jenħtieġ li jiġi rrapportat fil-munita li fiha huwa ddenominat il-prezz tat-titolu jew tal-komodità. Jenħtieġ li din il-munita tkun speċifikata fil-“Munita tal-prezzijiet” (Kamp 2.50). Barra minn hekk, jenħtieġ li l-prezz tat-titolu ma jinkludi l-ebda rekwiżit tal-marginazzjoni, skont, valwazzjoni pożittiva, suppliment, eċċ. li minflok jenħtieġ li jiġu rrapportati bħala parti mill-valur tas-Suq tal-kollateral (Kamp 2.88), anki jekk jiġu kkalkolati min-naħa tas-self tat-tranżazzjoni.

273. Rigward il-Kamp 2.46 “Kwantità jew ammont nominali”, ammont nominali jenħtieg li jiġi rrapportat biss għall-bonds. L-ammont nominali jenħtieg li jiġi rrapportat fil-munita oriġinali speċifikata f’“Munita tal-ammont nominali” (Kamp 2.48). Titoli oħrajn jenħtieg li jiġu rrapportati bħala kwantità, f’liema każ “Unità ta’ kejl” (Kamp 2.47) trid timtela filwaqt li “Munita tal-ammont nominali” (Kamp 2.48) tithalla vojta.
274. “Valur ta’ self” jiġi kkalkulat fil-munita li fiha jkun denominat it-titolu skont il-formula ta’ hawn taħt, aktar milli fil-munita li fiha ż-żewġ kontropartijiet ikunu kkonkludew it-tranzazzjoni. Madankollu, “valur tas-suq” jirrappreżenta l-valutazzjoni tat-titoli mogħtija b’self mill-kontropartijiet. Din il-valwazzjoni tista’ tkun f’munita differenti minn dik li fiha jkun iddenominat it-titolu mogħti b’self. Jekk jogħġbok irreferi wkoll għall-eżempju fit-Taqsima 5.2.1.8.
275. Il-valur tas-self jiġi kkalkolat kif ġej:

$$\text{Valur tas} - \text{self (kamp 2.56)} =$$

*Kwantità jew ammont nominali (kamp 2.46) \* Prezz tat – titolu jew tal – komodità (kamp 2.49)*

276. Jista’ jkun hemm każijiet li fihom il-valwazzjoni tat-titoli mogħtija b’self (jew it-titoli użati bħala kollateral) ma tkunx possibbli, li tirrifletti n-nuqqas ta’ disponibbiltà ta’ informazzjoni dwar il-prezzijiet. Dan huwa l-każ, pereżempju, b’ishma sospiżi, jew xi titoli ta’ introjtu fiss f’segmenti tas-suq illikwidi. Mal-konklużjoni ta’ SFTs li jinvolve l-użu ta’ tali titoli, jenħtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw il-valwazzjoni li tkun għet miftiehma kuntrattwalment. Jekk issir disponibbli informazzjoni ġdida dwar il-prezzijiet, jenħtieg li l-aġġornamenti tal-valwazzjoni jiġu rrapportati miż-żewġ kontropartijiet fil-“Valur tas-suq” (Kamp 2.57).

### 5.3.12 Titoli

#### 5.3.12.1 Kwalità tat-titolu / tal-kollateral

277. Il-kampijiet tal-Kwalità tat-titolu (Kamp 2.51) u tal-Kwalità tal-kollateral (Kamp 2.90) jenħtieg li jiġu ppopolati mill-entitajiet tar-rapportar b’wieħed mill-valuri speċifikati fl-ITS dwar ir-rapportar.
278. Jenħtieg li l-valur “NOAP” jintuża għat-tipi ta’ kollateral li ġejjin (Kamp 2.94): Ekwitajiet ta’ indici ewlieni (MEQU), Ekwitajiet oħra (OEQU), u Assi oħra (OTHR) li għalihom mhumieq applikabbli klassifikazzjonijiet tal-kreditu skont it-tifsira tar-Regolament (KE) Nru 1060/2009 (CRAR)<sup>14</sup>. Il-valur “NOTR” jenħtieg li jintuża biss għal strumenti li jistgħu jiġu kklassifikati iżda li ma għandhomx klassifikazzjoni tal-kreditu.
279. Biex jirrapportaw din l-informazzjoni, u biex jevitaw dipendenza mekkanistika fuq klassifikazzjonijiet tal-kreditu skont l-Artikolu 5a tar-Regolament CRA, jenħtieg li l-kontropartijiet joqogħdu fuq il-valutazzjoni interna tal-kwalità kreditizja tat-titoli, li jistgħu jinkludu klassifikazzjonijiet esterni minn CRA waħda jew aktar.

<sup>14</sup> Skont l-Artikolu 3 CRAR, “Klassifikazzjoni tal-kreditu” tfisser opinjoni dwar l-affidabbiltà kreditizja ta’ entità, dejn jew obbligu finanzjarju, titolu tad-dejn, sehem preferut jew strument finanzjarju ieħor, jew ta’ emittent ta’ tali dejn jew obbligu finanzjarju, titolu tad-dejn, sehem privileġġat jew strument finanzjarju ieħor, maħruġa bl-użu ta’ sistema ta’ klassifikazzjoni stabbilita u ddefinita ta’ kategoriji ta’ klassifikazzjoni.”

280. Il-valur irrapportat jenħtiegħ li jirrifletti kemm jista' jkun mill-qrib il-karatteristiċi tat-titolu. Meta klassifikazzjonijiet esterni jkunu ntużaw bħala input għall-popolazzjoni tal-Kamp 2.51, jenħtiegħ li idealment il-kontropartijiet jibbażaw il-valutazzjoni tagħhom fuq il-klassifikazzjoni tal-istrument aktar milli fuq il-klassifikazzjoni tal-emittent, jekk tkun disponibbli. Id-denominazzjoni tal-munita (munita lokali vs barranija) u l-maturità (terminu qasir vs terminu twil) jenħtiegħ li jirriflettu l-karatteristiċi speċifiċi tat-titolu.
281. Jenħtiegħ li l-kontropartijiet jirrapportaw l-informazzjoni dwar il-kwalità tat-titolu bl-aktar mod konsistenti possibbli billi din se tintuża għar-rikonċiljazzjoni. Madankollu, ESMA għet mgħarrfa dwar il-limitazzjonijiet possibbli li jistgħu jipprevjenu lill-entitajiet milli jaqsmu din l-informazzjoni, f'liema każ il-kontropartijiet li jirrapportaw jenħtiegħ li jirrapportaw il-valur li jirrifletti bl-aħjar mod il-valutazzjoni interna tagħhom.

### 5.3.12.2 Bonds

282. Il-prezz fil-każ ta' bonds jenħtiegħ li jiġi rrapportat bħala perċentwal, iżda mhux bħala frazzjoni deċimali ta' 1.
283. It-Tabella 67 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ ta' SFT li tinvolvi titoli tal-gvern ta' grad ta' investiment u kklassifikati bħala strument ta' dejn (bonds) b'ammont nominali ta' EUR 100,000,000.
284. It-titoli, f'dan l-eżempju, inħarġu minn emittent Ġermaniż (Kamp 2.53) identifikat bl-LEI tiegħu (Kamp 2.54).
285. Il-prezz ta' titolu huwa espress bħala perċentwal, 99.5%, (Kamp 2.49), il-munita tiegħu hija l-euro (Kamp 2.50), u d-data ta' maturità tat-titoli hija t-22 ta' April 2030 (Kamp 2.50).
286. Il-valur tas-self tal-SFT huwa ta' EUR 99,500,000 (Kamp 2.56) u l-mutwatarju ma għandux aċċess esklużiv biex jieħu b'self mill-portafoll tat-titoli tas-sellief (Kamp 2.68).

Tabella 67 - Bonds			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;SctiesLndg&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Scty&gt;                 &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;               &lt;/Scty&gt;             &lt;/AsstTp&gt;           &lt;/SctiesLndg&gt;           &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;           &lt;QtyOrNmnlVal&gt;             &lt;NmnlVal&gt; </pre>
41	Security identifier	{ISIN}	
42	Classification of a security	{CFI}	
46	Quantity or nominal amount	100000000	
48	Currency of nominal amount	EUR	
49	Security or commodity price	99.5	
50	Price currency		
51	Security quality	INVG	
52	Maturity of the security	2030-04-22	



Tabella 67 - Bonds			
No	Field	Example	XML Message
53	Jurisdiction of the issuer	DE	<pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;   &lt;/NmnlVal&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;99.5&lt;/Ptrg&gt;   &lt;/UnitPric&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;   &lt;LEI&gt;   NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;    &lt;JurstdctnCtry&gt;DE&lt;/JurstdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;    &lt;ExclsvArrgmnt&gt;&gt;false&lt;/ExclsvArrgmnt&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;LnVal Ccy="EUR"&gt;99500000&lt;/LnVal&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/LnData&gt;    &lt;CollData&gt;   ...   &lt;/CollData&gt;   ...    &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt;DBFTFR&lt;/ </pre>
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
55	Security type	GOVS	
56	Loan value	99500000	
68	Exclusive arrangements	FALSE	

### 5.3.12.3 Ekwitajiet ta' indici ewlieni

287. It-Tabella 68 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet f'każ ta' SFT li tinvolvi ekwità li hija parti minn indici ewlieni, jiġifieri ekwitajiet ta' indici ewlieni (Kamp 2.55) bi kwantità ta' 100,000 (Kamp 2.46). Il-kamp 2.48 mhuwiex applikabbli peress li l-Kamp 2.46 huwa ppopolata bi kwantità u mhux b'ammont nominali.
288. Jenhtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw ekwitajiet bħala MEQU fejn dawn jitqiesu bħala tali skont ir-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni 2016/1646.
289. It-tip ta' assi jerga' jkun titolu (Kamp 2.40) bħala ekwitajiet (Kamp 2.42). Il-kwalità tat-titolu mhijjex applikabbli għal dan it-tip ta' titoli (Kamp 2.51).

290. It-titoli, f'dan l-eżempju, inħarġu minn emittent Franciż (Kamp 2.53) identifikat bl-LEI tiegħu (Kamp 2.54).
291. Il-prezz tat-titolu huwa espress f'unitajiet u huwa ta' EUR 9.95 (Kamp 2.49 u Kamp 2.50). Minħabba li s-sottostanti hija ekwità, ma hemm l-ebda data ta' maturità tat-titoli, u għalhekk, il-Kamp 2.52 jenħtieġ li jimtela bl-istandard ISO 8601 "9999-12-31".
292. Il-valur tas-self tal-SFT huwa ta' EUR 995,000 (Kamp 2.56) u l-mutwatarju ma għandux aċċess esklużiv biex jieħu b'self mill-portafoll tat-titoli tas-sellief (Kamp 2.68).

Tabella 68 – Ekwitajiet ta' indiċi ewlieni			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<SctiesFincgRptgTxRpt <TradData>
41	Security identifier	{ISIN}	<Rpt> <New>
42	Classification of a security	{CFI}	<CtrPtyData> ...
46	Quantity or nominal amount	100000	</CtrPtyData> ...
49	Security or commodity price	9.95	<LnData> <SctiesLndg>
50	Price currency	EUR	<AsstTp> <Scty>
51	Security quality	NOAP	<Id>FR0000120271</Id>
52	Maturity of the security	9999-12-31	<ClssfctnTp>ESVUFN</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
53	Jurisdiction of the issuer	FR	<Qty>100000</Qty> </QtyOrNmnlVal>
54	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<UnitPric> <MntryVal>
55	Security type	MEQU	<Amt Ccy="EUR">9.95</Amt>
56	Loan value	995000	</MntryVal> </UnitPric> <Qty>NOAP</Qty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id> <LEI> 529900S21EQ1BO4ESM68 </LEI> </Id>
68	Exclusive arrangements	FALSE	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp>  <ExclsvArrgmnt>>false</ExclsvArrgmnt> </Scty> </AsstTp>

**Tabella 68 – Ekwitajiet ta' indici ewlieni**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LnVal Ccy="EUR"&gt;995000&lt;/LnVal&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.3.12.4 Titoli oħra mingħajr maturità

293. It-Tabella 69 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet fil-każ ta' SFT li tinvolvi titoli li mhumiex fil-lista pprovduta mill-Kamp 2.55 tal-Anness I tal-ITS. F'dan il-każ, il-Kamp 2.55 jenħtieġ li jiġi ppopolat b'"assi oħra". Il-kwantità tat-titoli hija ta' 100,000 (Kamp 2.46). Il-kamp 2.48 mhuwiex applikabbli peress li l-Kamp 2.46 huwa ppopolata bi kwantità u mhux b'ammont nominali.
294. It-tip ta' assi mill-ġdid huwa titolu (Kamp 2.40) ikklassifikat bħala ESVUFN (Kamp 2.42). Il-kwalità tat-titolu mhijiex applikabbli għal dan it-tip ta' titoli (Kamp 2.51).
295. It-titoli, f'dan l-eżempju, inħarġu minn emittent Franciż (Kamp 2.53) identifikat bl-LEI tiegħu (Kamp 2.54)
296. Il-prezz tat-titolu huwa espress f'unitajiet u, f'dan l-eżempju, huwa ta' EUR 99.5 (Kamp 2.49 u Kamp 2.50). It-titoli ma għandhom l-ebda data ta' maturità tat-titoli; għalhekk, il-Kamp 2.52 jenħtieġ li jmtela bl-istandard ISO 8601 "9999-12-31".
297. Il-valur tas-self tal-SFT huwa ta' EUR 9,950,000 (Kamp 2.56) u l-mutwatarju ma għandux aċċess esklużiv biex jieħu b'self mill-portafoll tat-titoli tas-sellief (Kamp 2.68).

**Tabella 69 – Titoli oħra mingħajr maturità**

No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	SECU	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; </pre>
41	Security identifier	{ISIN}	
42	Classification of a security	{CFI}	
46	Quantity or nominal amount	100000	
49	Security or commodity price	99.5	
50	Price currency	EUR	



299. Fl-eżempju, il-kwantità ta' 100,000 (Kamp 2.46) titkejjel fi Bramel (Kamp 47) bi prezz għal kull BARL ta' 60 USD (Kamp 49, u Kamp 50).

300. Il-valur tas-self huwa 6,000,000 (Kamp 56).

Tabella 70 - SFTs li jinvolve komoditajiet			
No	Field	Example	XML Message
40	Type of asset	COMM	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;SctiesLndg&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Cmmdty&gt;                 &lt;Clssfctn&gt;                   &lt;Nrgy&gt;                     &lt;Oil&gt;                       &lt;BasePdct&gt;NRGY&lt;/Base Pdct&gt;                       &lt;SubPdct&gt;OILP&lt;/SubPdc t&gt;                       &lt;AddtlSubPdct&gt;BRNT&lt;/A ddtlSubPdct&gt;                     &lt;/Oil&gt;                   &lt;/Nrgy&gt;                 &lt;/Clssfctn&gt;               &lt;Qty&gt;                 &lt;Val&gt;100000&lt;/Val&gt;               &lt;UnitOfMeasr&gt;BARL&lt;/UnitO fMeasr&gt;             &lt;/Qty&gt;           &lt;UnitPric&gt;             &lt;MntryVal&gt;               &lt;Amt Ccy="USD"&gt;60&lt;/Amt&gt;             &lt;/MntryVal&gt;           &lt;/UnitPric&gt;         &lt;/Cmmdty&gt;       &lt;/AsstTp&gt;           &lt;LnVal Ccy="USD"&gt;6000000&lt;/LnVal&gt;         &lt;/SctiesLndg&gt;       &lt;/LnData&gt; </pre>
43	Base product	NRGY	
44	Sub - product	OIL	
45	Further sub - product	BRNT	
46	Quantity or nominal amount	100000	
47	Unit of measure	BARL	
49	Securities or commodities price	60	
50	Price currency	USD	
56	Loan value	6000000	

Tabella 70 - SFTs li jinvolvu komoditajiet			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.14 SLB ta' ribass ta' flus

301. It-Tabella 71 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet fil-każ li l-kontropartijiet jaqblu fuq rata ta' ribass varjabbli bbażata fuq l-indiċi EONIA (Kamp 2.59) b'perjodu ta' żmien ta' referenza f'jiem tar-rata varjabbli ta' ribass (Kamp 2.60) b'numru sħiħ multiplikatur tal-perjodu ta' żmien ta' jum wieħed (1) (Kamp 2.61).
302. Il-kontropartijiet qablu wkoll fuq frekwenza ta' bażi ta' ġimgħa għall-pagament tar-rata varjabbli ta' ribass (Kamp 2.62) u (Kamp 2.63). Iz-żewġ kampijiet biex jiġu ffaċilitati tranżazzjonijiet li ma jiddefinixxux frekwenza tal-pagamenti tar-rata varjabbli ta' ribass.
303. Ir-rata varjabbli tirisettja b'perjodu ta' żmien ta' jiem (Kamp 2.64) b'multiplikatur ta' jum wieħed (1) (Kamp 2.65)
304. In-numru ta' punti bażi li għandhom jiżdiedu (jew jitnaqqsu fil-każ ta' valur negattiv li huwa permess għal dan il-kamp) bħala firxa għar-rata tal-imgħax varjabbli sabiex tiġi ddeterminata r-rata tal-imgħax huwa "5" (Kamp 2.66).

Tabella 71 - SLB ta' ribass ta' flus			
No	Field	Example	XML Message
58	Fixed rebate rate		<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;TxLnData&gt; &lt;SctiesLndg&gt; ... &lt;RbtRate&gt; </pre>
59	Floating rebate rate	EONA	
60	Floating rebate rate reference period - time period	DAYS	
61	Floating rebate rate reference period - multiplier	1	
62	Floating rebate rate payment frequency - time period	WEEK	

Tabella 71 - SLB ta' ribass ta' flus			
No	Field	Example	XML Message
63	Floating rebate rate payment frequency - multiplier	1	<Fltg> <RefRate> <Indx>EONA</Indx> </RefRate>
64	Floating rebate rate reset frequency - time period	DAYS	<Term> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val>
65	Floating rebate rate reset frequency - multiplier	1	</Term> <PmtFrqcy> <Unit>WEEK</Unit> <Val>1</Val>
66	Spread of the rebate rate	5	</PmtFrqcy> <RstFrqcy> <Unit>DAYS</Unit> <Val>1</Val> </RstFrqcy> <BsisPtSprd>5</BsisPtSprd> </Fltg> </RbtRate> </SctiesLndg> </TxLnData> </LnData> <CollData> ... </CollData> ... </New> </TradData> ... </SctiesFincgRptgTxRpt>

### 5.3.15 SLB ibbażati fuq tariffi: SLB ta' kollateral mhux fi flus, SLB ta' pula ta' flus u SLB mhux kollateralizzati

305. SLB ibbażati fuq tariffi jkopru tliet tipi ta' SLBs: SLB ta' kollateral mhux fi flus, SLB ta' pula ta' flus u SLB mhux kollateralizzati. It-tliet tipi kollha għandhom l-istess loġika ta' rapportar.
306. It-Tabella 72 fiha l-valur li għandu jiġi rrapportat mill-kontropartijiet fil-Kamp 67 "Tariffa tas-self" meta jikkonkludu kollateral mhux fi flus, pula ta' flus u SLB mhux kollateralizzati (SLB mhux ta' ribass). It-tariffa tas-self, f'dan il-każ, hija ta' 1.23456 % u hija ppopolata mingħajr sinjal percentwali li huwa riżervat għat-tikketti xml.

Tabella 72 - Kollateral mhux fi flus			
No	Field	Example	XML Message
67	Lending fee	1.23456	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData> <Rpt> <New>

**Tabella 72 - Kollateral mhux fi flus**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;LndgFee&gt;1.23456&lt;/LndgFee&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; ...   &lt;CollData&gt; ...   &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.3.16 Ammont ta' self b'marġni u valur qasir tas-suq

307. L-ammont globali pendenti ta' self b'marġni (Kamp 2.69) jenħtieġ li jew jiġi rrapportat bħala 0 (meta l-klijent ikollu kreditu ta' flus kumplessiv/ikollu pożizzjoni twila fi flus) jew bħala valur pożittiv (meta l-klijent ikollu debitu ta' flus kumplessiv/ikollu pożizzjoni qasira fi flus fil-munita bażi). Jenħtieġ li l-munita bażi dejjem tiġi rrapportata, kif definit fil-ftehim bilaterali bejn sensar finanzjarju prim u l-klijent tiegħu.
308. Il-valur tas-self b'marġni kumplessiv jiġi kkalkolat abbażi ta' kostitwenti individwali ta' self b'marġni skont il-munita (Kampijiet 2.33 u 2.34). Jenħtieġ li dawn il-kampijiet jiġu ripetuti kemm-il darba jkun hemm bżonn biex jiġu inklużi l-muniti kollha użati fil-kont. Dan jippermetti lill-awtoritajiet jimmonitorjaw debitu ta' flus tal-klijenti (jiġifieri self b'marġni) f'muniti individwali, għall-kuntrarju ta' debitu nett fil-munita bażi biss, kif ukoll kreditu ta' flus f'muniti individwali użat bħala kollateral. F'konformità mal-ammont kumplessiv tas-self b'marġni, debitu nett ta' klijent f'munita partikolari jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala valur pożittiv flimkien mal-munita, filwaqt li kreditu nett ta' klijent jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala valur negattiv.
309. Jenħtieġ li valur qasir tas-suq dejjem jiġi ppopolat b'valur denominat fil-munita bażi tas-self b'marġni, kif definit fil-ftehim bilaterali (Kamp 2.70). Huwa mistenni ammont monetarju wieħed għal kull UTI u, għalhekk, il-valur qasir tas-suq jenħtieġ li jiġi rrapportat fuq bażi netta, fl-aħħar tal-ġurnata. Fir-rigward tas-self b'marġni pendenti, kwalunkwe kreditu fi flus nett użat biex jiġi kollateralizzat il-valur qasir tas-suq jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala valur negattiv (Kamp 2.33) flimkien mal-munita tiegħu (Kamp 2.34).
310. Meta l-ammont ta' self b'marġni jkun ta' 0, jiġifieri meta l-klijent ikollu kreditu nett ta' flus fil-munita bażi, u l-valur qasir tas-suq ikun 0 ukoll, jenħtieġ li l-Kampijiet 2.33, 2.69 u 2.71 ilkoll jimtlew b' 0. Jenħtieġ li jiġi rrapportat ukoll aġġornament tal-kollateral "żero".



### 5.3.16.1 Bilanċi pożittivi u negattivi f'xi muniti u d-debitu nett fil-munita bażi

311. It-Tabella 73 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ ta' debitu nett fil-munita bażi, li tirrifletti f'dan l-eżempju partikolari kreditu f'USD u debitu f'GBP u EUR. Għas-sempliċità, ir-rati tal-kambju USD-EUR u GBP-EUR f'dan l-eżempju huma ssettjati indaqs għal 1.

Tabella 73 - Bilanċi pożittivi u negattivi f'xi muniti u d-debitu fil-munita bażi			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;MrgnLndg&gt; &lt;OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR"&gt;150000&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt; &lt;ShrtMktValAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/ShrtMktValAmt&gt; &lt;MrgnLnAttr&gt; &lt;Amt&gt; &lt;Amt Ccy="USD"&gt;- 100000&lt;/Amt&gt; &lt;Amt Ccy="GBP"&gt;50000&lt;/Amt&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/Amt&gt; &lt;/Amt&gt; &lt;/MrgnLnAttr&gt; &lt;/MrgnLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	
33	Margin lending currency amount	50000	
34	Margin lending currency	GBP	
33	Margin lending currency amount	150000	
34	Margin lending currency	EUR	
69	Outstanding margin loan	100000	
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	
71	Short market value	0	

### 5.3.16.2 Kreditu nett fil-munita bażi u valur qasir tas-suq

312. It-Tabella 74 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ ta' kreditu nett fi flus f'munita bażi (GBP), u għalhekk, is-self b'marġni pendenti huwa rrapportat bħala 0, bi kreditu fi flus mhux fil-munita bażi (USD) użat bħala kollateral mill-klijent biex ikopri parti mill-valur qasir tas-suq.

Tabella 74 - Kreditu fil-munita baži u valur qasir pożittiv tas-suq			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	-100000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;MrgnLndg&gt;           &lt;OutsdngMrgnLnAmt             Ccy="GBP"&gt;0&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt;           &lt;ShrtMktValAmt             Ccy="GBP"&gt;500000&lt;/ShrtMktValAmt&gt;           &lt;MrgnLnAttr&gt;             &lt;Amt&gt;               &lt;Amt Ccy="USD"&gt;-                 100000&lt;/Amt&gt;             &lt;/Amt&gt;           &lt;/MrgnLnAttr&gt;         &lt;/MrgnLndg&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         ...       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	
69	Outstanding margin loan	0	
70	Base currency of outstanding margin loan	GBP	
71	Short market value	500000	

### 5.3.16.3 Kreditu nett fil-munita baži u l-ebda valur tas-suq qasir

313. It-Tabella 75 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet tar-rapportar fil-każ ta' kreditu fi flus fil-munita baži (EUR) u l-ebda valur qasir tas-suq. Peress li ma hemm l-ebda self b'marġni pendenti jew valur qasir tas-suq, il-kreditu fi flus mhuwiex rapportabbli (minħabba li ma jintużax bħala kollateral f'self b'marġni jew valur qasir tas-suq). Madankollu, huwa meħtieġ rapport biex l-awtoritajiet jiġu nnotifikati dwar il-bilanċ żero. Il-munita baži, kif oriġinarjament miftiehma fil-kuntratt oriġinali, jenħtieġ li tiġi ppopolata.

Tabella 75 - Kreditu fil-munita baži u l-ebda valur qasir tas-suq			
No	Field	Example	XML Message
33	Margin lending currency amount	0	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt; </pre>
34	Margin lending currency	USD	
69	Outstanding margin loan	0	

**Tabella 75 - Kreditu fil-munita bażi u l-ebda valur qasir tas-suq**

No	Field	Example	XML Message
70	Base currency of outstanding margin loan	EUR	<pre> ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;MrgnLndg&gt;     &lt;OutsdngMrgnLnAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/OutsdngMrgnLnAmt&gt;     &lt;ShrtMktValAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/ShrtMktValAmt&gt;     &lt;MrgnLnAttr&gt;       &lt;Amt&gt;         &lt;Amt Ccy="USD"&gt;0&lt;/Amt&gt;       &lt;/Amt&gt;     &lt;/MrgnLnAttr&gt;   &lt;/MrgnLndg&gt; &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;           ...           &lt;/CollData&gt;           ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
71	Short market value	0	

## 5.4 Data dwar il-kollateral

314. It-taqsimiet sussegwenti jenfasizzaw il-popolazzjoni ta' sett partikolari ta' kampijiet li jaqsmu karatteristiċi speċifiċi tal-kollateral ta' SFT. Dan ikun jippermetti biex il-kontropartijiet li jirrapportaw jivvalutaw direttament l-informazzjoni li jenħtieġ li jirrapportaw għal kull taqsima tad-*data* speċifika meta din tkun applikabbli.
315. Ir-regoli dwar il-validazzjoni jinkludu l-gwida kompluta dwar il-kampijiet applikabbli għal kull tip ta' SFT u tip ta' azzjoni, kif ukoll id-dipendenzi rilevanti.

### 5.4.1 Ir-rapportar ta' kollateralizzazzjoni ta' SLB

316. Skont jekk is-SLB ikunx ikkollateralizzat jew mhux ikkollateralizzat, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw din l-informazzjoni fil-Kamp 2.72 "Marka tas-Self ta' Titoli ("SL") Mhux Ikkollateralizzat".

#### 5.4.1.1 SLB Mhux Ikkollateralizzat

317. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw "veru" fil-Kamp 2.72 "Marka tas-Self ta' Titoli ("SL") Mhux Ikkollateralizzat" meta jkun hemm self mhux ikkollateralizzat ta' titoli iżda xorta waħda dan ikun organizzat bħala tranżazzjoni SLB.

#### 5.4.1.2 SLB ikkollateralizzat

318. Jenħtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw “falz” f’“Marka tas-Self ta’ Titoli (“SL”) Mhux Ikkollateralizzat” (Kamp 2.72) meta t-tranzazzjoni SLB tkun ikkollateralizzata jew meta l-kontropartijiet jaqblu li jikkollateralizzaw in-negozju, iżda l-allokkazzjoni specifika tal-kollateral ma tkunx għadha magħrufa.

#### 5.4.2 Kollateralizzazzjoni

319. Meta l-basket ta’ kollateral ma jkunx magħruf fil-ħin tar-rapportar, jenħtieg li l-Kamp 2.96 jiġi ppopolat b’“NTAV”. L-istess jgħodd għal repos li jseħħu fuq pjattaformi tal-GC. F’dak il-każ, jenħtieg li l-kontropartijiet jaġġornaw l-informazzjoni dwar l-identifikazzjoni ta’ basket ta’ kollateral malli jkunu jafuha u mbagħad jaġġornaw l-informazzjoni dwar il-komponenti tal-kollateral sa mhux aktar tard mill-jum ta’ xogħol ta’ wara d-data tal-valur.

320. Meta l-kollateralizzazzjoni ma sseħħx kontra basket ta’ kollateral, l-ESMA tistenna li l-kontropartijiet jenħtieg li jirrapportaw l-elementi rilevanti tal-kollateral.

##### 5.4.2.1 Tranzazzjoni waħda b’basket ta’ kollateral

321. It-Tabella 76 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet fil-każ li jiġu nnegozjati żewġ SFTs separati kontra basket ta’ kollateral (Kamp 2.96) identifikat bl-ISIN “GB00BH4HKS39”. Jista’ jkun hemm diversi SFTs innegozjati kontra basket ta’ kollateral, mingħajr ma jkun hemm kollateralizzazzjoni fuq bażi ta’ skopertura netta. L-SFTs jiġu kkollateralizzati fil-livell tat-tranzazzjonijiet (Kamp 2.73 ippopolat b’“FALZ”).

Tabella 76 - Tranzazzjoni waħda b’basket ta’ kollateral			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	

**Tabella 76 - Tranzazzjoni waħda b'basket ta' kollateral**

No	Field	Example	XML Message
98	Action type	NEWT	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</AgtLndr> </OthrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>
1.9	Counterparty side	GIVE	<UnqTradlDr>UT1</UnqTradlDr>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	</Tp> </MstrAgrmt>
3	Event date	24/04/2020	</RpTrad> </LnData>
9	Master agreement	GMRA	<CollData> <RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<NetXpsrCollstnInd>>false</NetXpsrCollstnInd>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData>
98	Action type	NEWT	... </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id> <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id> <LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>

**Tabella 76 - Tranzazzjoni waħda b'basket ta' kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UT12&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;    &lt;Bsktldr&gt;   &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt;   &lt;/Bsktldr&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;    ...    &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.2.2 Tranzazzjoni waħda b'identifikazzjoni ta' basket mhux magħrufa fil-ħin tar-rapportar

322. It-Tabella 77 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet fil-każ ta' tranzazzjoni waħda li tkun ikkollateralizzata b'basket ta' kollateral iżda fejn l-identifikazzjoni tal-basket ma tkunx disponibbli fil-ħin tar-rapportar (Kamp 2.96 ippopolat b'"NTAV").

323. L-SFT hija kkollateralizzata fil-livell ta' tranzazzjoni unika (Kamp 2.73). L-SFT hija kollateralizzata fuq il-baži tat-tranzazzjoni (Kamp 2.73 ippopolat b'"FALZ").

**Tabella 77 - Tranzazzjoni waħda mingħajr basket fil-ħin tar-rapportar**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt; </pre>

**Tabella 77 - Tranzazzjoni waħda mingħajr basket fil-hin tar-rapportar**

No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<pre> &lt;New&gt;   &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;         &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/OthrCtrPty&gt;       &lt;OthrPtyData&gt;         &lt;AgtLndr&gt;           &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;         &lt;/AgtLndr&gt;       &lt;/OthrPtyData&gt;     &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;       &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;       &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;       &lt;MstrAgrmt&gt;         &lt;Tp&gt;           &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;         &lt;/Tp&gt;       &lt;/MstrAgrmt&gt;     &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;     &lt;RpTrad&gt;       &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;       &lt;Bsktldr&gt;         &lt;Id&gt;NTAV&lt;/Id&gt;       &lt;/Bsktldr&gt;     &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

#### 5.4.2.3 Kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta bil-basket

324. Tabella 78 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet fil-każ ta' żewġ tranżazzjonijiet ikkollateralizzati b'basket ta' kollateral (Kamp 2.96) fuq bażi ta' skopertura netta (Kamp 2.73 ippopolat b' "VERU") u identifikat bl-ISIN "GB00BH4HKS39". Dan l-eżempju ma jfissirx li l-ftehimiet kollha tal-GC huma fuq bażi ta' skopertura netta. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw l-SFTs kif jiġu konklużi.
325. Ta' min isemmi li meta l-SFTs ikunu kkollateralizzati fuq bażi ta' skopertura netta b'basket, il-messaġġi tas-COLU jenħtieġ li jinkludu l-komponenti tal-kollateral individwali. Ir-rapportar tal-ISIN tal-basket huwa biss sakemm tiġi definita l-allokkazzjoni ta' titoli. Il-komponenti tal-kollateral jenħtieġ li jiġu rrapportati kif inhuma fl-añħar tal-ġurnata.

Tabella 78 - Bażi ta' skopertura netta bil-basket			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;RptgCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;             &lt;Sd&gt;GIVE&lt;/Sd&gt;           &lt;/RptgCtrPty&gt;           &lt;OthrCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;             &lt;/OthrCtrPty&gt;             &lt;OthrPtyData&gt;               &lt;AgtLndr&gt;                 &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;               &lt;/AgtLndr&gt;             &lt;/OthrPtyData&gt;           &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;           &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;           &lt;MstrAgrmt&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	
98	Action type	NEWT	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.9	Counterparty side	GIVE	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender	



**Tabella 78 - Bazi ta' skopertura netta bil-basket**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Tp> <Tp>GMRA</Tp>
3	Event date	24/04/2020	</Tp> </MstrAgrmt>
9	Master agreement	GMRA	</RpTrad>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</LnData> <CollData>
96	Collateral basket identifier	{ISIN}	<RpTrad>
98	Action type	NEWT	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>  <Bsktldr> <Id>GB00BH4HKS39</Id> </Bsktldr> </RpTrad> </CollData>  ...  </New> </Rpt> <Rpt> <New> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>  <LEI>12345678901234500000</LEI> </Id> <Sd>GIVE</Sd> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>  <LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>  <LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>  <UnqTradldr>UTI2</UnqTradldr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> <MstrAgrmt> <Tp>

**Tabella 78 - Bażi ta' skopertura netta bil-basket**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;Bsktldr&gt; &lt;Id&gt;GB00BH4HKS39&lt;/Id&gt; &lt;/Bsktldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;  ...  &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.2.4 Kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta b'identifikazzjoni tal-basket mhux magħrufa fil-ħin tar-rapportar

326. It-Tabella 79 turi l-popolazzjoni tal-kampijiet meta tranżazzjoni tkun ikkollateralizzata fuq bażi ta' skopertura netta (Kamp 2.73 ippopolat b"VERU" b'basket ta' kollaterali li l-identifikatur tiegħu jew mhuwix ISIN jew l-ISIN għadu mhux magħruf (Kamp 2.96 ippopolat b"NTAV").

327. Il-kollateralizzazzjoni tat-tranżazzjoni tkun fuq bażi ta' skopertura netta (Kamp 2.73).

**Tabella 79 - Bażi ta' skopertura netta mingħajr basket fil-ħin tar-rapportar**

No	Field	Example	XML Message
73	Collateralisation of net exposure	true	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt;  ...  &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt;  &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt; </pre>
96	Collateral basket identifier	NTAV	
98	Action type	NEWT	

**Tabella 79 - Bażi ta' skopertura netta mingħajr basket fil-hin tar-rapportar**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Bsktldr&gt;   &lt;Id&gt;NTAV&lt;/Id&gt; &lt;/Bsktldr&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

### 5.4.3 Kollataral fi flus

328. It-Tabella 80 turi r-rapportar tal-kampijiet f'każ ta' ribass fi flus u ta' tranżazzjoni SLB f'pula ta' flus. Fl-eżempju, il-kollateralizzazzjoni ssir b'kollateral fi flus ta' EUR 1,000,000 (Kamp 2.76 u Kamp 2.77). Ix-xenarju tar-rapportar għal dan il-każ huwa l-istess għat-tip ta' azzjoni "NEWT" u "COLU".

**Tabella 80 - Kollataral fi flus**

No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	1000000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;New&gt;       ...       &lt;CtrPtyData&gt;         ...       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         ...       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;         &lt;RpTrad&gt;           &lt;AsstTp&gt;             &lt;Csh&gt;               &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;1000000&lt;/Amt&gt;             &lt;/Csh&gt;           &lt;/AsstTp&gt;         &lt;/RpTrad&gt;       &lt;/CollData&gt;       ...     &lt;/New&gt;   &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	

#### 5.4.4 Rapportar ta' kollateral żero

329. Sabiex jiġi ssimplifikat ir-rapportar meta l-kollateral ikun ugwali għal 0, minbarra is-self b'marġni, il-kollateral jenfitegħ li dejjem jiġi rrapportat bħala kollateral fi flus, bl-ammont tal-kollateral fi flus jkun ugwali għal 0 u t-tip ta' komponent tal-kollateral li jkun "FLUS" irrispettivament minn jekk it-tip ta' kollateral użat qabel għal dik l-SFT kienx titoli, komoditajiet jew flus.
330. It-Tabella 81 turi r-rapportar tal-kampijiet f'każ li l-kollateral ikun ugwali għal 0 u t-tip ta' komponent tal-kollateral ikun jew titoli, jew komoditajiet (għal repos u għal BSB/SBBs biss), jew flus.

Tabella 81 – Rapportar ta' kollateral żero għal titoli, għal komoditajiet u għal flus			
No	Field	Example	XML Message
75	Type of collateral component	CASH	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...           &lt;/CtrPtyData&gt;           &lt;LnData&gt;             ...             &lt;/LnData&gt;           &lt;CollData&gt;             &lt;RpTrad&gt;               &lt;AsstTp&gt;                 &lt;Csh&gt;                   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/Amt&gt;                 &lt;/Csh&gt;               &lt;/AsstTp&gt;             &lt;/RpTrad&gt;           &lt;/CollData&gt;         ...       &lt;/CollUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
76	Cash collateral amount	0	
77	Cash collateral currency	EUR	

#### 5.4.5 Kampijiet tal-kollateral ta' garanzija

331. Rigward it-titoli li d-dettalji tagħhom ma jkunux disponibbli, ir-rapportar huwa obligatorju sad-data tal-valur + jum wieħed (1). Għal kwistjonijiet relatati mas-saldu, jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 5.4.8 tal-Linji Gwida. Fil-każ ta' basktijiet ta' kollateral, fejn id-dettalji jiġu rrapportati darba biss li tkun saret l-allokkazzjoni tal-kollateral, jekk jogħġbok irreferi għat-Taqsima 5.4.2 tal-Linji Gwida.

#### 5.4.5.1 Telf impost

332. Jenħtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw *data* dwar il-kollateral skont it-Tabella 2 tal-Anness tal-RTS dwar ir-Rapportar.
333. Il-valur tas-suq tal-kollateral (Kamp 2.88) jenħtieg li jiġi rrapportat bil-valur ġust, eskluż it-telf impost. Fi kliem ieħor, il-valur tas-suq tal-kollateral jenħtieg li jinkludi l-kollateral *kollu* ddepożitat mill-fornitur tal-kollateral, inkluż kollateral pendenti iżda li jkun għadu mhux saldat, qabel kwalunkwe tnaqqis tat-telf impost.
334. It-telf impost jew il-marġni (Kamp 2.89) jenħtieg li jiġi rrapportat fil-livell tal-ISIN bħala % għat-tipi kollha ta' SFT. Għal repos, it-telf impost huwa miftiehem kuntrattwalment u jenħtieg li jiġi stabbilit għad-durata tal-SFT, sakemm il-kontropartijiet ma jinnegożjawx mill-ġdid it-telf impost. It-telf impost jiġi kkalkolat bħala 1 nieqes il-proporzjon bejn il-flus u l-valur tal-kollateral, multiplikat b' 100. Pereżempju, repo b'100 fi flus u b'105 f'kollateral jipproduċi telf impost ta'  $100*[1-(100/105)]=4.7619$  u jenħtieg li jiġi rrapportat bħala "4.7619". Fil-każ ta' telf impost fil-livell tal-portafolli (jiġifieri fejn bi ftehim bejn il-kontropartijiet ikun applikat telf impost wieħed fuq il-portafoll sħiħ tal-kollateral repo), japplikaw l-istess prinċipji. Kif speċifikat fl-RTS dwar ir-rapportar, it-telf impost fil-livell tal-portafolli jenħtieg li jiġi rrapportat ukoll fil-livell tal-ISIN, jiġifieri jenħtieg li jiġi ripetut għal kull ISIN fil-portafoll (u għall-flus kontanti jekk ikun parti mill-portafoll):
335. Għal SLB, it-"Telf impost jew marġni" (Kamp 2.89) jenħtieg li jinkludu biss telf impost li japplika għan-naħa tal-kollateral. Minflok, ir-rekwiżiti tal-marġni jiġu koperti permezz tal-valur tas-suq tal-kollateral (Kamp 2.88) u l-ammont ta' kollateral fi flus (Kamp 2.76). Għalhekk, il-valur tas-suq tal-kollateral u l-ammont ta' kollateral fi flus jenħtieg li jiġu aġġornati wkoll bi kwalunkwe supplimentazzjoni (bħal mark-ups fuq is-self) li jibdedw japplikaw matul it-tranzazzjoni.
336. It-Tabella 82 turi *data* dwar il-kollateral minn SLB fejn titoli b'valur ta' EUR 100.000 jittieħdu b'self kontra EUR 100.000 f'kollateral fi flus (Kamp 2.76 u Kamp 2.77), jiġifieri l-ebda telf impost, li jfisser li t-telf impost jenħtieg li jiġi rrapportat bħala 0 (Kamp 2.89).

Tabella 82 – Il-kollateral fi flus mingħajr telf impost			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	100000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           ...         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;AsstTp&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	

**Tabella 82 – Il-kollateral fi flus minghajr telf impost**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Csh&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/Amt&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

337. It-Tabella 83 turi garanzija fuq self b'valur ta' EUR 100,000 ikkollateralizzata b' USD 105,000 fi flus (Kamp 2.76 u Kamp 2.77), li tirrifletti margni ta' 105% fuq in-naħa tas-self.

**Tabella 83 – Il-kollateral fi flus f'munita barranija b'marġni**

No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	105000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;New&gt;     ...     &lt;CtrPtyData&gt;     ...     &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;LnData&gt;     ...     &lt;/LnData&gt;     &lt;CollData&gt;     &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;     &lt;Csh&gt;     &lt;Amt Ccy="USD"&gt;105000&lt;/Amt&gt;     &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;     &lt;/Csh&gt;     &lt;/AsstTp&gt;     &lt;/RpTrad&gt;     &lt;/CollData&gt;     ...   &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	USD	
89	Haircut or margin	0	

338. Fl-eżempju ta' kollateral "Imħallat" (Tabella 84), garanziji fuq self b'valur ta' EUR 100,000 huma kkollateralizzati b'EUR 55,000 f'kollateral fi flus (Kamp 2.76) u b'EUR 60,000 f'kollateral mhux fi flus (Kamp 2.88). Dan jinkludi rekwiżit ta' marġni (mhux speċifikat) fuq in-naħa tas-self, li japplika kemm għall-kollateral fi flus kif ukoll għall-kollateral mhux fi flus, li bħala suppliment għalihom ikun hemm telf impost ta' 5% fuq il-valur tat-titoli użati bħala kollateral. Il-kamp 2.89 jiġi ppopolat b'"0" għall-kollateral fi flus, u b'"5" għat-titoli użati bħala kollateral.

Tabella 84 – Kollateral "imħallat" b'telf impost u b'marġni			
No	Field	Example	XML Message
76	Cash collateral amount	55000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;New&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;60000&lt;/MktVal&gt; &lt;HrcutOrMrgn&gt;5&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;55000&lt;/Amt&gt; &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
77	Cash collateral currency	EUR	
89	Haircut or margin	0	
88	Collateral market value	60000	
89	Haircut or margin	5	<pre> &lt;HrcutOrMrgn&gt;5&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;55000&lt;/Amt&gt; &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/New&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

339. Telf impost negattiv jista' jiġi rrapportat sal-punt li l-valur tal-kollateral ikun iżgħar mill-valur tas-self. Jenħtieġ li s-sinjali tat-telf impost ma jvarjazz man-naħa tal-kontroparti.

340. It-Tabella 85 turi repo li fih tranżazzjoni hija kkollateralizzata b'basket ta' titoli (din id-darba mingħajr flus) u telf impost fil-livell tal-portafoll japplika għat-titoli kollaterali kollha. L-istess telf impost jenħtieġ li jiġi rrapportat għal kull komponent tal-kollateral fil-portafoll (inkluż flus

jekk ikunu parti mill-portafoll). Self b'valur ta' EUR 150,000 huwa kkollateralizzat b'zewg titoli, EUR 110,000 f'garanzija A u 50,000 f'garanzija B. Il-valur totali tas-suq tal-kollateral iddepożitat huwa ta' EUR 160,000, li jikkorrispondi għal telf impost fil-livell tal-portafolli ta'  $100 * [1 - (150/160)] = 6.25\%$ . Dan huwa l-valur li jenħtieġ li jiġi rrapportat fil-Kamp 2.89 għal kull ISIN. Bl-istess mod, għall-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta (Kamp 2.73), l-istess telf impost jenħtieġ li jiġi rrapportat għal kull titolu individwali.

Tabella 85 – Portafoll tal-Kollateral b'telf impost fil-livell tal-portafolli			
No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	110000	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           ...         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Scty&gt;                 &lt;MktVal                   Ccy="EUR"&gt;110000&lt;/MktVal&gt;                 &lt;/Scty&gt;               &lt;/RpTrad&gt;             &lt;HrcutOrMrgn&gt;6.25&lt;/HrcutOrMrgn&gt;           &lt;/Scty&gt;         &lt;/CollData&gt;         &lt;/New&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
89	Haircut or margin	6.25	
88	Collateral market value	50000	
89	Haircut or margin	6.25	

341. Għal self b'marġni, fejn rekwizit ta' telf impost jew ta' marġni japplika għall-portafoll sħiħ tal-kollateral, il-valur irrapportat fil-Kamp 2.89 jenħtieġ li jiġi ripetut fl-ISINs u fl-elementi ta' flus kollha. Jekk dan ma jkunx il-każ u jkun japplika t-telf impost, minflok, fuq bażi ta' titolu b'titolu, jenħtieġ li jiġu rrapportati t-telf impost jew il-marġini speċifiċi għall-ISIN (fl-istess format bħal ta' SFTs oħrajn, jiġifieri f%).



#### 5.4.5.2 Tip ta' Kollateral

342. It-tip ta' kollateral (Kamp 2.94) jenħtiegħ li jiġi rrapportat mill-kontropartijiet b'wieħed mill-valuri li ġejjin:
- "GOVS" - Titoli tal-gvern;
  - "SUNS" - Titoli supranazzjonali u aġenziji;
  - "FIDE" - Titoli ta' dejn (inklużi bonds koperti) maħruġa minn banek u minn istituzzjonijiet finanzjarji oħra;
  - "NFID" - Titoli ta' dejn korporattiv (inklużi bonds koperti) maħruġa minn istituzzjonijiet mhux finanzjarji;
  - "SEPR" - Prodotti titolizzati (inklużi ABS, CDO, CMBS, RMBS, ABCP);
  - "MEQU" - Ekwità ta' indiċi ewlieni (inklużi bonds konvertibbli);
  - "OEU" - Ekwitajiet oħra (inklużi bonds konvertibbli);
  - "OTHR" - Assi oħrajn (inklużi ishma f'fondi mutwi).
343. Għal titoli oħra, il-kontropartijiet jistgħu jiddependu fuq sorsi uffiċjali oħra sabiex jimminimizzaw ir-riskju ta' inkonsistenzi u kwistjonijiet ta' rikonċiljazzjoni. Għad-definizzjoni ta' titoli tal-gvern, jenħtiegħ li l-entitajiet relaturi jużaw bħala referenza n-nota 19 f'qiegħ il-paġna tal-istandards tal-FSB dwar il-ġbir ta' *data* tal-SFT u jibbażaw fuq l-approċċ standardizzat ta' Basel III. Jekk waħda mill-kontropartijiet ma tkunx ikkonċernata bir-rekwiżiti ta' Basel III, jenħtiegħ li l-kontropartijiet jaqblu dwar il-valur li għandu jiġi rrapportat għal dan il-kamp.
344. Id-distinzjoni bejn "Ekwitajiet ta' indiċi ewlieni" u "Ekwitajiet oħra" hija konformi mal-istandards tal-FSB. Madankollu, huwa f'idejn il-membri tal-FSB li jiddeċiedu liema indiċijiet jenħtiegħ li jikkwalifikaw bħala "Ewlenin", dment li dawn jiġu ddefiniti f'konformità mal-implimentazzjoni tal-qafas tal-FSB/BCBS dwar telf impost f'SFTs ikklirjati mhux ċentralment.
345. L-ITS tal-ESMA dwar l-indiċijiet ewlenin u l-iskambji rikonnoxxuti skont ir-Regolament dwar ir-Rekwiżiti Kapitali (CRR)<sup>15</sup> jinkludu lista ta' indiċijiet ewlenin (Anness I, Tabelli 1 u 2). Il-lista tinkludi indiċi ta' ekwità u ta' bonds konvertibbli li jkopru assi ġewwa u barra l-UE. Din il-lista jenħtiegħ li tintuża bħala referenza għall-klassifikazzjoni ta' ekwitajiet u ta' bonds konvertibbli bħala "Indiċi ewlieni" jew "Oħra".

#### 5.4.5.3 Disponibbiltà għall-użu mill-ġdid tal-kollateral

346. Jenħtiegħ li l-kontropartijiet jippopolaw il-kamp filwaqt li jqisu biss l-abbiltà kuntrattwali ta' użu mill-ġdid tal-kollateral. Meta "Metodu użat biex jiġi pprovdut il-kollateral" (Kamp 2.20) jiġi rrapportat bħala "TTCA" jew "SIUR", "Disponibbiltà għall-użu mill-ġdid tal-kollateral" (Kamp 2.95) jenħtiegħ li dejjem tiġi ppopolata b'"VERU". Jenħtiegħ li hawnhemm ja jiġux ikkunsidrati restrizzjonijiet operazzjonali jew rekwiżiti regolatorji li jistgħu jipprevjenu l-użu

---

<sup>15</sup> Ir-Regolament ta' implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2016/1646 tat-13 ta' Settembru 2016.

mill-ġdid milli jseñħ. Il-kapaċità kuntrattwali tal-użu mill-ġdid jenħtieġ li tiġi ddeterminata bil-Ftehim Prinċipali, li jiddefinixxi t-tip ta' arranġament tal-kollateral użat fl-SFT.

347. Pereżempju, CCP li tgħaddi l-kollateral ta' SFT minn CM wieħed lil ieħor taħt "TTCA" jenħtieġ li tirrapporta li l-kollateral huwa disponibbli għall-użu mill-ġdid, anki jekk ma tkunx tista' tagħmel hekk skont il-kundizzjonijiet tal-ikklijar tas-CCP. L-istess jgħodd għall-UCITS: kollateral mhux fi flus riċevut li huwa disponibbli għall-użu mill-ġdid jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala tali, anki jekk ma jistax jerga' jintuża skont il-Linji Gwida tal-ESMA dwar ETFs u kwistjonijiet oħra ta' UCITS.
348. Fl-aħħar nett, kun af li "Disponibbiltà għall-użu mill-ġdid tal-kollateral" ma tqisx jekk il-kollateral ikunx intuża jew ikunx se jerga' jintuża. Huwa biss meta l-kollateral jintuża mill-ġdid -- li jinkludi l-użu ta' titoli meħuda b'self taħt arranġamenti SLB -- li jenħtieġ li jintbagħat ukoll rapport ta' użu mill-ġdid (ara t-Taqsima 5.6.1).

#### 5.4.5.4 Plain Vanilla Bonds

349. It-Tabella 86 turi r-rapportar ta' plain vanilla bonds użati bħala kollateral fl-24 ta' April 2020.
350. F'dan il-każ, EUR 102,000,000 f'titoli ta' dejn tal-gvern tal-Ġermanja identifikati bl-ISIN "DE0010877643" u kklassifikati bħala "DBFTFR" b'telf impost ta' 2% u data ta' maturità fit-22 ta' April 2030 intużaw bħala kollateral fi tranżazzjoni repo. It-titoli huma magħrufa u rrapportati fl-iskeda ta' żmien tar-rapportar flimkien mal-bqija tal-informazzjoni fuq in-naħa tas-self. Il-kwalità tat-titoli hija grad ta' investiment – "INVG" u l-kollateral huwa disponibbli għall-użu mill-ġdid sussegwenti. It-tabella tiffoka biss fuq il-kampijiet rilevanti għar-rapportar tal-kollateral.
351. Il-munita tal-ammont nominali tal-kollateral jew il-kwantità hija fakultattiva iżda jenħtieġ li tiġi rrapportata meta jiġi rrapportat ammont nominali. F'każijiet li fihom tiġi rrapportata kwantità (eż. ekwità), jenħtieġ li dan il-kamp ma jiġix ippopolat.
352. Rigward id-data tal-valur tal-kollateral, dan il-kamp huwa applikabbli biss għal SLB fil-kuntest ta' kollateral imħallas minn qabel.
353. Id-definizzjoni ta' Prezz għal kull unità (Kamp 2.87) tispeċifika li l-valur irrapportat jenħtieġ li jinkludi l-imgħax dovut għal titoli li jrendu l-imgħax, jiġifieri l-prezz maħmuġ.

Tabella 86 - Bonds normali			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
75	Type of the collateral component	SECU	<Rpt> <New>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	... <CtrPtyData> ...
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>

Tabella 86 - Bonds normali			
No	Field	Example	XML Message
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	<EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</LnData> <CollData>
86	Price currency		<RpTrad> <AsstTp>
87	Price per unit	102	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
88	Collateral market value	102000000	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <NmnlVal>
89	Haircut or margin	2	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
90	Collateral quality	INVG	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	2030-04-22	<UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	</UnitPric> <MktVal
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	Ccy="EUR">102000000</MktVal>
94	Collateral type	GOVS	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
95	Availability for collateral reuse	true	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI>  </Id>  <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>  <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>  </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData>  ...  </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.4.5.5 Bonds perpetwi

354. It-Tabella 87 turi r-rapportar ta' EUR 102,000,000 ta' bonds perpetwi tal-gvern Spanjol użati bħala kollateral. Jiġi applikat telf impost ta' 2%. It-titoli huma magħrufa u rrapportati fl-iskeda ta' żmien tar-rapportar flimkien mal-bqija tal-informazzjoni fuq in-naħa tas-self. Il-kwalità tat-titoli hija grad ta' investiment – "INVG" u l-kollateral huwa disponibbli għall-użu mill-ġdid. It-tabella tiffoka biss fuq il-kampijiet rilevanti għar-rapportar tal-kollateral.
355. Il-munita tal-ammont nominali tal-kollateral jew il-kwantità hija fakultattiva iżda jenħtieġ li tiġi rrapportata meta jiġi rrapportat ammont nominali. F'każijiet li fihom tiġi rrapportata kwantità (eż. ekwità), jenħtieġ li dan il-kamp ma jiġix ippopolat.
356. Rigward id-data tal-valur tal-kollateral, dan il-kamp huwa applikabbli biss għal SLB fil-kuntest ta' kollateral imħallas minn qabel.
357. Id-definizzjoni ta' Prezz għal kull unità (Kamp 2.87) tispeċifika li l-valur irrapportat jenħtieġ li jinkludi l-imgħax dovut għal titoli li jrendu l-imgħax, jiġifieri l-prezz maħmuġ.

Tabella 87 - Bonds perpetwi			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;New&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           ...         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;LnData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/LnData&gt;         &lt;CollData&gt;           &lt;RpTrad&gt;             &lt;AsstTp&gt;               &lt;Scty&gt;                 &lt;Id&gt;ES0010877643&lt;/Id&gt;               &lt;/Scty&gt;             &lt;/AsstTp&gt;           &lt;/RpTrad&gt;         &lt;/CollData&gt;         &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTPR&lt;/ClssfctnTp&gt;         &lt;QtyOrNmnlVal&gt;           &lt;NmnlVal&gt;             &lt;Amt               Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;             &lt;/NmnlVal&gt;           &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;           &lt;UnitPric&gt;             &lt;Ptrg&gt;102&lt;/Ptrg&gt;           &lt;/UnitPric&gt;           &lt;MktVal             Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;           &lt;/MktVal&gt;         &lt;/LnData&gt;       &lt;/New&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	102	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	2	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	9999-12-31	
92	Jurisdiction of the issuer	ES	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

Tabella 87 - Bonds perpetwi			
No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn>
95	Availability for collateral reuse	true	<Qlty>INVG</Qlty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE </LEI> </Id> <JursdctnCtry>ES</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp> </RpTrad> </CollData> ... </New> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.4.5.6 Ekwitajiet ta' Indici Ewlieni

358. It-Tabella 88 turi r-rapportar tal-ekwitajiet ta' indici ewlieni "MEQU" użati bħala kollateral, f'dan il-każ, EUR 105,000,000 f'Total ta' ekwitajiet CAC40 Franciżi, b'kodiċi CFI ESVUFN b'telf impost ta' 5%. It-titoli huma magħrufa u rrapportati fl-iskeda ta' żmien tar-rapportar flimkien mal-bqija tal-informazzjoni fuq in-naħa tas-self. Il-kamp "Kwalità tal-kollateral" tiġi ppopolata b'"NOAP", peress li l-klassifikazzjoni mhijiex applikabbli għal dawn it-titoli. Huma disponibbli għall-użu mill-ġdid sussegwenti.
359. Il-munita tal-ammont nominali tal-kollateral jew il-kwantità hija fakultattiva iżda jenħtieġ li tiġi rrapportata meta jiġi rrapportat ammont nominali. F'każijiet li fihom tiġi rrapportata kwantità (eż. ekwità), jenħtieġ li dan il-kamp ma jiġix ippopolat.
360. Rigward id-data tal-valur tal-kollateral, dan il-kamp huwa applikabbli biss għal SLB fil-kuntest ta' kollateral imħallas minn qabel.
361. Id-definizzjoni ta' Prezz għal kull unità (Kamp 2.87) tispeċifika li l-valur irrapportat jenħtieġ li jinkludi l-imgħax dovut għal titoli li jrendu l-imgħax, jiġifieri l-prezz maħmuġ.

Tabella 88 - Ekwitajiet ta' Indici Ewlieni			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-24	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
75	Type of the collateral component	SECU	<Rpt> <New>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<CtrPtyData> ... ...
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</CtrPtyData> <LnData>
83	Collateral quantity or nominal amount	10000000	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt> </RpTrad>
86	Price currency	EUR	</LnData> <CollData>
87	Price per unit	10.5	<RpTrad> <AsstTp>
88	Collateral market value	105000000	<Scty> <Id> FR0000120271</Id> <ClssfctnTp> ESVUFN
89	Haircut or margin	5	</ClssfctnTp>
90	Collateral quality	NOAP	<QtyOrNmnlVal> <Qty>100000000</Qty> </QtyOrNmnlVal>
91	Maturity date of the security	9999-12-31	<UnitPric> <MntryVal>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<Amt> Ccy="EUR">10.5</Amt> </MntryVal>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</UnitPric> <MktVal>
94	Collateral type	MEQU	Ccy="EUR">105000000</MktVal>
95	Availability for collateral reuse	true	<HrcutOrMrgn>5</HrcutOrMrgn> <Qlty>NOAP</Qlty> <Mtrty>9999-12-31</Mtrty> <Issr> <Id>
98	Action type	NEWT	<LEI>529900S21EQ1BO4ESM68</LEI> </Id> <JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>MEQU</Cd> </Tp> <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty> </AsstTp>

Tabella 88 - Ekwitajiet ta' Indiċi Ewlieni			
No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.6 Proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni fil-livell tat-tranzazzjonijiet għal SFTs ikklirjati mhux ċentralment

362. Ir-referenzi f'din is-subtaqsima għal SLB jew għal *repo* huma maħsuba biss biex jipprovdu eżempji bi ftehimiet principali differenti. Madankollu, tipi oħra ta' SFTs, bħal BSB/SBB jew SFTs li jinvolvu komoditajiet jenħtieġ li jiġu rrapportati abbażi tal-istess prinċipji.
363. Barra minn hekk, l-eżempji f'din is-subtaqsima jirreferu għall-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni fil-livell ta' SFTs individwali. L-eżempji fit-taqsima li ġejja se juru minflok ir-rapportar tal-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni bil-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoni netta.
364. Is-sinjali negattivi għall-komponenti tal-kollateral meta parti mill-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta jindikaw l-istat fl-aħħar tal-ġurnata, u mhux il-fluss għal dik il-ġurnata partikolari. Filwaqt li huma numerikament dawn jistgħu jikkoinċidu, id-differenza hija fundamentali. Għalhekk, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw l-istat ta' kull komponent ta' kollateral fi tmiem il-ġurnata. Aktar gwida hija inkluża fil-paragrafu 374.
365. Għas-semplificazzjoni, fl-eżempji ta' hawn taħt, it-telf impost huwa rrapportat bħala 0. Jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw it-telf impost kif ikkalkolat skont it-taqsima 5.4.5.1.

##### 5.4.6.1 Il-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' SLB bi provvista addizzjonali tal-istess titoli mill-fornitur tal-kollateral

366. It-Tabella 89 turi aġġornament ta' margni ta' varjazzjoni fil-każ ta' SLB għall-eżempju tal-plain vanilla bonds fit-Tabella 86: zieda ta' 1,000,099 fl-ammont nominali ta' kollateral ipprovduta biex tikkumpensa għal tnaqqis fil-prezz tal-bond minn 102 għal 100.99, kif irrapportat mill-fornitur tal-kollateral. Jenħtieġ li kemm il-fornitur tal-kollateral kif ukoll ir-riċevitur tal-kollateral jirrapportaw eżattament bl-istess mod l-informazzjoni dwar il-kollateral, kif spjegat fit-Tabella 89.

Tabella 89 - Aġġornament tal-margni ta' varjazzjoni għal SLB			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	

**Tabella 89 - Aġġornament tal-marġni ta' varjazzjoni għal SLB**

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	<CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<LEI>12345678901234500000</LEI>
3	Event date	24/04/2020	</Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	SECU	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <SctiesLndg>
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		<UnqTradlDr>UTI1</UnqTradlDr> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
87	Price per unit	100.99	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	102000000	<Tp>GMSLA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </SctiesLndg>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData> <SctiesLndg> <Collsd> <AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp>
94	Collateral type	GOVS	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">101000099</Amt> </NmnlVal>
98	Action type	COLU	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100.99</Ptrg> </UnitPric>



**Tabella 89 - Aġġornament tal-marġni ta' varjazzjoni għal SLB**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;      &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;     &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;     &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;     &lt;Issr&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;      &lt;/Id&gt;  &lt;Jurisdiction&gt;DE&lt;/Jurisdiction&gt;     &lt;/Issr&gt;     &lt;Tp&gt;     &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;     &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;      &lt;/Scty&gt;     &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;      &lt;/Collsd&gt;     &lt;/SctiesLndg&gt;     &lt;/CollData&gt;      ...      &lt;/CollUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;     &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.6.2 Il-proviżjonament ta' marġni ta' varjazzjoni ta' repo bi provvista addizzjonali tal-istess titoli mill-fornitur tal-kollateral

367. It-Tabella 90 turi aġġornament ta' marġni ta' varjazzjoni fil-każ ta' *repo* għall-eżempju tal-plain vanilla bonds ifit-Tabella 86: zieda ta' 1,000,099 fl-ammont nominali tal-kollateral ipprovduta biex tikkompensa għal tnaqqis fil-prezz tal-bond minn 102 għal 100.99, kif irrapportat mill-fornitur tal-kollateral. Jenftieg li kemm il-fornitur tal-kollateral kif ukoll irriċevitur tal-kollateral għandom jirrapportaw eżattament bl-istess mod l-informazzjoni dwar il-kollateral, kif spjegat fit-Tabella 90.

**Tabella 90 - Aġġornament tal-marġni ta' varjazzjoni għal repo**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;     &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;     &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;     &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;     &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;     &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;     &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;     &lt;QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;NmnlVal&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	101000099	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100.99	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	

**Tabella 90 - Aġġornament tal-margni ta' varjazzjoni għal repo**

No	Field	Example	XML Message
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<pre> &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;101000099&lt;/Amt&gt;   &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;100.99&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt;   &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;  &lt;JurstdctnCtry&gt;DE&lt;/JurstdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
98	Action type	COLU	

5.4.6.3 Il-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' SLB b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral

368. It-Tabella 91 turi aġġornament ta' kollateral differenti mill-eżempju fit-Tabella 86 - tnaqqis ta' EUR 999,709 fl-ammont nominali tal- kollateral biex tikkumpensa għal zieda fil-prezz tal-bond minn 102 għal 103.03, kif irrapportat mill-fornitur tal-kollateral. Jenftieg li kemm il-fornitur tal- kollateral kif ukoll ir-riċevitur tal- kollateral jirrapportaw eżattament bl-istess mod l-informazzjoni dwar il-kollateral, kif spjegat fit-Tabella 91.

**Tabella 91 - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' SLB b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...       &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;       &lt;/Id&gt;       &lt;/OthrCtrPty&gt;       &lt;OthrPtyData&gt;       &lt;AgtLndr&gt;         &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;       &lt;/AgtLndr&gt;       &lt;/OthrPtyData&gt;       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;SctiesLndg&gt;       &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;       &lt;UnqTradIdr&gt;UT11&lt;/UnqTradIdr&gt;       &lt;MstrAgrmt&gt;       &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;       &lt;/Tp&gt;       &lt;/MstrAgrmt&gt;       &lt;/SctiesLndg&gt;       &lt;/LnData&gt;       &lt;CollData&gt;       &lt;SctiesLndg&gt;       &lt;Collsd&gt;       &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;       &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;       &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;       &lt;QtyOrNmnlVal&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	

**Tabella 91 - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' SLB b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
94	Collateral type	GOVS	<pre> &lt;NmnlVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;99000291&lt;/Amt&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt;    &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;    &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN &lt;/LEI&gt;    &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;    &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;    ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	

5.4.6.4 Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' repo b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral

369. It-Tabella 92 turi aġġornament ta' kollateral differenti mill-eżempju fit-Tabella 86 - tnaqqis ta' EUR 999,709 fl-ammont nominali ta' kollateral biex tikkumpensa għal zieda fil-prezz tal-bond minn 102 għal 103.03, kif irrapportat mill-fornitur tal-kollateral. Jenħtieġ li kemm il-fornitur tal- kollateral kif ukoll ir-riċevitur tal- kollateral jirrapportaw eżattament bl-istess mod l-informazzjoni dwar il-kollateral, kif spjegat fit-Tabella 92.

Tabella 92 - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' repo b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollUpd&gt;       ...     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;     &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	FALSE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	99000291	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	
88	Collateral market value	102000000	
89	Haircut or margin	0	

**Tabella 92 - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni ta' repo b'ritorn tal-istess titoli lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
90	Collateral quality	INVG	<pre> &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;         &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;       &lt;/Scty&gt;     &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;NmnlVal&gt;       &lt;Amt         Ccy="EUR"&gt;99000291&lt;/Amt&gt;       &lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;UnitPric&gt;       &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt;     &lt;/UnitPric&gt;     &lt;MktVal       Ccy="EUR"&gt;102000000&lt;/MktVal&gt;     &lt;/MktVal&gt;     &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;     &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;     &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;     &lt;Issr&gt;       &lt;Id&gt;         &lt;LEI&gt;NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN       &lt;/LEI&gt;     &lt;/Issr&gt;     &lt;JursdctnCtry&gt;DE&lt;/JursdctnCtry&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;     &lt;/Tp&gt;     &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
98	Action type	COLU	<pre> &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;   &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;&gt;false&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

#### 5.4.7 Proviżjonament ta' marġni ta' varjazzjoni għal SFTs ikklirjati mhux ċentralment fil-każ ta' kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoni netta

370. Fil-każ ta' kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoni netta, minbarra l-kollateral li huwa transferit bħala parti mit-tranzazzjoni, il-kontropartijiet jistgħu jaqblu li jikkollateralizzaw is-self li ġie konkluż taht l-istess tip ta' ftehim prinċipali fuq bażi netta.
371. Għalhekk, hemm każijiet li il-komponenti tal-kollateral li ġew ipprovduti fuq bażi netta mill-fornitur tal-kollateral jistgħu jiġu rritornati mir-riċevitur tal-kollateral. Dan isir jew biex jiġi żgurat li ma jkun hemm l-ebda kollateral eċċessiv għas-sett ta' tranzazzjonijiet ikkollateralizzati, jew li l-kollateral ma jaqbeż l-ebda limitu ta' telf impost jew ta' marġni li seta' ġie miftiehem bejn il-kontropartijiet.
372. Hemm ukoll każijiet li fihom, it-titoli li jiġu rritornati mir-riċevitur tal-kollateral ma jkunux eżattament l-istess bħat-titoli li oriġinarjament kienu ddepożitati mill-fornitur tal-kollateral. F'dak il-każ, isir meħtieġ li tiġi identifikata d-direzzjoni tat-trasferiment biex tkun tista' ssir il-kalkulazzjoni korretta tal-espożizzjoni u tal-livell ta' kollateralizzazzjoni.
373. Għalhekk, biex ikun żgurat li ir-rapportar tal-kollateral huwa konsistenti, rigward il-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoni netta:
- Meta l-kollateral jiġi skambjat f'SFTs li huma ikklirjati mhux ċentralment bħala parti mill-marġni ta' varjazzjoni ta' espożizzjoninetta bejn iż-żewġ kontropartijiet, dawn jenħtieġ li jirrapportaw f' XML l-ammont ta' titoli u l-valur tas-suq ta' dawk b'sinjal li jirrifletti l-istat ta' kull titolu mill-perspettiva tagħhom stess.
  - Jekk il-fornitur tal-kollateral iżid il-kollateral bħala marġni ta' varjazzjoni, jenħtieġ li jirrapporta l-valur tas-suq tal-kollateral il-ġdid fuq bażi ta' espożizzjoni netta b'sinjal negattiv.
  - Jekk ir-riċevitur tal-kollateral ikun qed jirritorna parti mill-istess kollateral żejjed li diġà kien ipprovdut bħala marġni ta' varjazzjoni, jenħtieġ li jirrapporta l-valur tas-suq tal-kollateral nett il-ġdid fuq bażi ta' espożizzjoni netta b'sinjal pożittiv, filwaqt li l-fornitur tal-kollateral jenħtieġ li jirrapporta l-valur tas-suq tal-kollateral nett il-ġdid b'sinjal negattiv.
  - Jekk il-fornitur tal-kollateral jirċievi komponenti tal-kollateral li jkunu differenti mill-komponenti tal-kollateral ipprovduti inizjalment, jenħtieġ li jirrapporta l-valur tas-suq tal-kollateral għal dawk il-komponenti tal-kollateral il-ġodda b'sinjal pożittiv.
  - Min-naħa l-oħra, ir-riċevitur tal-kollateral jenħtieġ li jirrapporta b'sinjal pożittiv il-komponenti tal-kollateral riċevuti bħala parti mill-marġni tal-varjazzjoni u b'sinjal negattiv il-komponenti tal-kollateral mogħtija lill-fornitur tal-kollateral, li huma differenti mill-komponenti tal-kollateral meħuda fl-ewwel lok.
374. Dan it-tip ta' rapportar huwa applikabbli biss għal messagġi tas-COLU fejn (i) il-kollateralizzazzjoni hija fuq bażi ta' skopertura netta u (ii) ma hemm l-ebda UTI rapportat għall-komponent(i) tal-kollateral. Dan ir-rapportar mhuwiex applikabbli għall-allokazzjonijiet ta' kollateral abbażi ta' kull tranzazzjoni.
375. Kull meta jkun hemm kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta, il-kontropartijiet għandhom jibagħtu messagġi tas-COLU għal kull waħda mill-SFTs li jkunu kkollateralizzati



fil-livell tat-tranzazzjonijiet, u messaġġ wieħed tas-COLU għall-kollateral li jintuża bħala margni ta' varjazzjoni.

5.4.7.1 Espożizzjoni netta – Margni ta' varjazzjoni -rigward ta' pula ta' flus għal SLB li huma kkollateralizzati b'kollateral fi flus fil-livell tat-tranzazzjonijiet.

376. Fl-eżempju fit-Tabella 93, l-SLBs inizjalment huma kkollateralizzati bi flus kontanti (SLB ta' ribass ta' flus), u mbagħad il-kontropartijiet iwettqu margni ta' varjazzjoni kontra pula ta' flus.

377. Il-flus normalment ma jkollhomx telf impost u, f'dan il-każ, il-margni fuq in-naħa tas-self jitqies ukoll li huwa żero. B'mod speċifiku, fir-rigward tat-telf impost u tal-margni, jenftieg li l-kontropartijiet jirreferu għal-linji gwida fis-sottotaqsima 5.4.5.1 tat-taqsima 5.4.4.

Tabella 93 - Espożizzjoni netta - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni fir-rigward ta' pula ta' flus kontanti għal SLB li huma kkollateralizzati fi flus kontanti fil-livell tat-tranzazzjonijiet			
No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt;   &lt;TradData&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;CollUpd&gt;         ...         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;CtrPtyData&gt;             &lt;RptgCtrPty&gt;               &lt;Id&gt;                 &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/RptgCtrPty&gt;           &lt;OthrCtrPty&gt;             &lt;Id&gt;               &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;             &lt;/Id&gt;           &lt;/OthrCtrPty&gt;           &lt;OthrPtyData&gt;             &lt;AgtLndr&gt;               &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;             &lt;/AgtLndr&gt;           &lt;/OthrPtyData&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;/CtrPtyData&gt;       &lt;LnData&gt;         &lt;SctiesLndg&gt;           &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;         &lt;/SctiesLndg&gt;       &lt;/LnData&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;UnqTradIdr&gt;UT11&lt;/UnqTradIdr&gt;           </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UT11	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	100000000	
77	Cash collateral currency	EUR	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	

**Tabella 93 - Espożizzjoni netta - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni fir-rigward ta' pula ta' flus kontanti għal SLB li huma kkollateralizzati fi flus kontanti fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<pre> &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;Collsd&gt;       &lt;AsstTp&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;/Scty&gt;         &lt;Csh&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/AsstTp&gt;       &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;     &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/CollData&gt; </pre>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	100000000	
77	Cash collateral currency	EUR	
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<pre> &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt;       &lt;/OthrCtrPty&gt;     &lt;OthrPtyData&gt;       &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;       &lt;/AgtLndr&gt;     &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt; </pre>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMSLA	
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	5000000	
77	Cash collateral currency	EUR	
98	Action type	COLU	

**Tabella 93 - Espożizzjoni netta - Il-provizjonament ta' margni ta' varjazzjoni fir-rigward ta' pula ta' flus kontanti għal SLB li huma kkollateralizzati fi flus kontanti fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;  &lt;UnqTradlDr&gt;UTI2&lt;/UnqTradlDr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;     &lt;Collsd&gt;       &lt;AsstTp&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;/Scty&gt;         &lt;Csh&gt;           &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/AsstTp&gt;       &lt;/Collsd&gt;     &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/CollData&gt;   ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;OthrCtrPty&gt;         &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;           &lt;/Id&gt;         &lt;/OthrCtrPty&gt;       &lt;OthrPtyData&gt;         &lt;AgtLndr&gt; </pre>

**Tabella 93 - Espożizzjoni netta - Il-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni fir-rigward ta' pula ta' flus kontanti għal SLB li huma kkollateralizzati fi flus kontanti fil-livell tat-tranzazzjonijiet**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;    &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;   &lt;Collsd&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;Csh&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;5000000&lt;/Amt&gt;   &lt;/Csh&gt;   &lt;/AsstTp&gt; &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/Collsd&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.2 Skopertura netta – Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting

378. It-Tabella 94 turi l-kollateral li jappartjeni għal tliet UTI, li inizjalment kienu kkollateralizzati fuq bażi ta' kull tranzazzjoni. Madankollu, dawn it-tliet repos ġew inkluzi f'sett ta' netting, u r-rapportar tal-kollateral sussegwenti jinkludi l-elementi kollaterali relatati mal-SFTs individwali identifikati bil-UTI tagħhom u l-kollateral użat għall-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta' skopertura netta.

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;   ...   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;RptgCtrPty&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNORST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradldr&gt;UT11&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;   &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR&lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;NmnlVal&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	100000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
75	Type of the collateral component	SECU	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Issr> <Id>
86	Price currency		<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI>
87	Price per unit	100	> </Id>
88	Collateral market value	50000000	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry>
89	Haircut or margin	0	</Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd>
90	Collateral quality	INVG	</Tp>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</Scty> <Scty>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
94	Collateral type	GOVS	</ClssfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
98	Action type	COLU	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Issr> <Id>

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI>
9	Master agreement	GMRA	</Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
75	Type of the collateral component	SECU	</Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</Scty> </AsstTp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
84	Collateral unit of measure		</RpTrad> </CollData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	... </CollUpd>
86	Price currency		</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
87	Price per unit	100	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
88	Collateral market value	50000000	<RptgCtrPty> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>12345678901234500000</LEI>
90	Collateral quality	INVG	</Id> </RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<Id>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData>
94	Collateral type	GOVS	<AgtLndr>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI>
98	Action type	COLU	</AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</CtrPtyData> <LnData> <RpTrad>

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<pre> &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;UnqTradIdr&gt;UTI2/UnqTradIdr&gt; &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;         &lt;Id&gt;FR0010877643&lt;/Id&gt;       &lt;/Scty&gt;     &lt;/AsstTp&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;NmnlVal&gt;       &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/Amt&gt;       &lt;/NmnlVal&gt;     &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;     &lt;UnitPric&gt;       &lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt;     &lt;/UnitPric&gt;     &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/MktVal&gt;   &lt;/MktVal&gt;   &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;     &lt;Id&gt;       &lt;LEI&gt;FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF&lt;/LEI&gt;     &lt;/Id&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt; </pre>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	5000000	
84	Collateral unit of measure		
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	5000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2040	
92	Jurisdiction of the issuer	NL	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	



**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	COLU	</RpTrad> </CollData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	... </CollUpd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>12345678901234500000</LEI>
9	Master agreement	GMRA	</Id> </RptgCtrPty>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</Id> </OthrCtrPty> <OthrPtyData>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<AgtLndr>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData>
84	Collateral unit of measure		</CtrPtyData> </CtrPtyData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradIdr>UTI3</UnqTradIdr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	2000000	<Tp>GMRA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </RpTrad>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<RpTrad> <AsstTp>
92	Jurisdiction of the issuer	IT	<Scty> <Id>NL0010877643</Id>

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp>
94	Collateral type	GOVS	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<Amt Ccy="EUR">5000000</Amt> </NmnlVal>
75	Type of the collateral component	SECU	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">5000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
84	Collateral unit of measure		<Issr> <Id>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<LEI>DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD </LEI>
86	Price currency		</Id>
87	Price per unit	100	<JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry> </Issr>
88	Collateral market value	2000000	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
89	Haircut or margin	0	</Tp>
90	Collateral quality	INVG	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	</Scty> </AsstTp>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</RpTrad> </CollData>
94	Collateral type	GOVS	...
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</CollUpd>
98	Action type	COLU	</Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
			<LEI>12345678901234500000</LEI>

**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;IT00BH4HKS39&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR &lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;NmnlVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Amt&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt; &lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt; &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt; &lt;lssr&gt; &lt;Id&gt; </pre>



**Tabella 94 – Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SciesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.3 Espożizzjoni netta - Il-marġni ta' varjazzjoni ta' SLBs ikkollateralizzati kontra pula tal-kollateral mhux fi flus b'ritorn ta' titoli ekwivalenti, iżda mhux identiċi, lill-fornitur tal-kollateral

379. It-Tabella 95 turi aġġornament aktar kumpless għall-kollateral. Ma hemm l-ebda kollateral fuq bażi ta' kull tranzazzjoni individwali; il-konklużjoni originali hija kontra grupp ta' kollateral. F'dan l-eżempju, wara żieda fil-prezz ta' wieħed mit-titoli użati biex tiġi kkollateralizzata l-espożizzjoni, jiġifieri l-prezz tal-bonds tal-gvern tal-Ġermanja żdied minn 102 għal 103.3, iżda r-riċevitur tal-kollateral jeħtieġ bonds tal-gvern tal-Ġermanja filwaqt li l-fornitur tal-kollateral jaċċetta li jirċievi bonds tal-gvern ta' Franza. Iż-żewġ kontropartijiet jaqblu dwar it-transazzjoni li ġejja: ir-riċevitur tal-kollateral jirritorna EUR 2,000,000 f'ammont nominali ta' kollateral tal-bond tal-gvern ta' Franza. Għalhekk il-valur tas-suq tal-kollateral tal-bonds Ġermaniżi ta' EUR 2,060,000 huwa kkompensat b'EUR 2,060,000 fil-valur tas-suq tal-kollateral tal-bonds Franċiżi li huwa fil-pussess tal-fornitur tal-kollateral (jiġifieri b'sinjal negattiv mill-perspettiva tar-riċevitur ta' kollateral), li jirrestawra l-bilanċ tal-kollateral nett inizjali.
380. Ta' min jinnota li l-kampijiet applikabbli għat-titoli fit-taqsimha ripetibbli tad-*data* dwar il-kollateral jiġu ripetuti darbtejn sabiex jiġu rrapportati d-dettalji rilevanti kollha. Iż-żewġ titoli huma disponibbli għall-użu mill-ġdid sussegwenti.
381. Kemm il-fornitur, kif ukoll ir-riċevitur tal-kollateral, għandhom jirrapportaw l-informazzjoni dwar il-kollateral, kif spjegat fit-Tabella 95 u inklużi s-sinjali rilevanti għall-komponenti tal-kollateral li huma parti mill-marġni ta' varjazzjoni fuq bażi ta' espożizzjoninetta, kif indikat fil-paragrafu 373.

**Tabella 95 - Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni ta' SLBs ikkollateralizzati kontra pula tal-kollateral b'ritorn ta' titoli ekwivalenti, iżda mhux identiċi, lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of the agent lender F	

**Tabella 95 - Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni ta' SLBs ikkollateralizzati kontra pila tal- kollateral b'ritorn ta' titoli ekwivalenti, iżda mhux identiċi, lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
3	Event date	24/04/2020	<pre> &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt; </pre>
9	Master agreement	GMSLA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	101000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		
87	Price per unit	103.03	<pre>   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMSLA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/SctiesLndg&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;SctiesLndg&gt;   &lt;Collsd&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Scty&gt;   &lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;   &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTPR&lt;/ClssfctnTp&gt;   &lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;NmnlVal&gt;   &lt;Amt   Ccy="EUR"&gt;101000000&lt;/Amt&gt;   &lt;/NmnlVal&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt;   &lt;/UnitPric&gt;   &lt;MktVal   Ccy="EUR"&gt;104060300&lt;/MktVal&gt; </pre>
88	Collateral market value	104060300	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	

**Tabella 95 - Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazżjoni ta' SLBs ikkollateralizzati kontra pila tal- kollateral b'ritorn ta' titoli ekwivalenti, iżda mhux identiċi, lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
86	Price currency		<Issr> <Id>
87	Price per unit	103.015	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI>
88	Collateral market value	-2060300	</Id>
89	Haircut or margin	0	<JurstdctnCtry>DE</JurstdctnCtry> </Issr>
90	Collateral quality	INVG	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> <Scty> <Id>FR0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	<ClsfctnTp>DBFTPR</ClsfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">-2000000</Amt> <Sgn>true</Sgn> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>103.015</Ptrg> </UnitPric> <MktVal Ccy="EUR">-2060300</MktVal>
98	Action type	COLU	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>  <LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF </LEI> </Id>  <JurstdctnCtry>FR</JurstdctnCtry> </Issr> <Tp>

**Tabella 95 - Espożizzjoni netta - Margni ta' varjazzjoni ta' SLBs ikkollateralizzati kontra pula tal- kollateral b'ritorn ta' titoli ekwivalenti, iżda mhux identiċi, lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;  &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;/Collsd&gt; &lt;/SctiesLndg&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt;  &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.4 Skopertura netta - Il-proviżjonament ta' margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral

382. L-eżempju fit-Tabella 96 huwa kontinwazzjoni tal-eżempju fit-Tabella 94. F'dan il-każ, hemm ritorn ta' wieħed mit-titoli pprovduti bħala MV, iżda aktar mill-kwantità inizjali pprovduta bħala margni ta' varjazzjoni.

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	



**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<OthrCtrPty> <Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </Id>
75	Type of the collateral component	SECU	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</OthrPtyData> </CtrPtyData>
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	</CtrPtyData> <LnData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UT1</UnqTradldr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp>
88	Collateral market value	100000000	<Tp>GMRA</Tp> </Tp>
89	Haircut or margin	0	</MstrAgrmt> </RpTrad>
90	Collateral quality	INVG	</LnData> <CollData>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<RpTrad> <AsstTp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Scty> <Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<NmnlVal> <Amt
95	Availability for collateral reuse	TRUE	Ccy="EUR">100000000</Amt> </NmnlVal>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<MktVal
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	Ccy="EUR">100000000</MktVal> <HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbaġħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
86	Price currency		<Issr> <Id>
87	Price per unit	100	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI>
88	Collateral market value	50000000	> </Id>
89	Haircut or margin	0	<JurisdictionCtry>DE</JurisdictionCtry>
90	Collateral quality	INVG	</Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Scty> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
94	Collateral type	GOVS	<ClassfctnTp>DBFTFR</ClassfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
98	Action type	COLU	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal> <UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric> <MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
3	Event date	24/04/2020	<Issr> <Id>
9	Master agreement	GMRA	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Id>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<JurisdictionCtry>DE</JurisdictionCtry>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbaġħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
84	Collateral unit of measure		</Scty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</AsstTp>
86	Price currency		<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
87	Price per unit	100	</RpTrad>
88	Collateral market value	50000000	</CollData>
89	Haircut or margin	0	...
90	Collateral quality	INVG	</CollUpd>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</Rpt>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<Rpt>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<CollUpd>
94	Collateral type	GOVS	<CtrPtyData>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<CtrPtyData>
98	Action type	COLU	<RptgCtrPty>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<Id>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<LEI>1234567890123450000</LEI>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</Id>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	</RptgCtrPty>
3	Event date	24/04/2020	<OthrCtrPty>
9	Master agreement	GMRA	<OthrPtyData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<AgtLndr>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbaġħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</LnData> <CollData> <RpTrad>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<AsstTp> <Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</ClssfctnTp>
84	Collateral unit of measure		<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
86	Price currency		</QtyOrNmnlVal>
87	Price per unit	100	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
88	Collateral market value	50000000	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
89	Haircut or margin	0	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
90	Collateral quality	INVG	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Issr> <Id>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
94	Collateral type	GOVS	</Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</Tp>
98	Action type	COLU	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</Scty> </AsstTp>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<NetXpsrCollstnInd>>true</NetXpsrCollstnInd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</RpTrad> </CollData> ...
3	Event date	24/04/2020	</CollUpd> </Rpt>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
9	Master agreement	GMRA	<Rpt> <CollUpd>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<RptgCtrPty> <Id>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
83	Collateral quantity or nominal amount	2000000	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
84	Collateral unit of measure		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNORST</LEI> </Id>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
86	Price currency		<AgtLndr>
87	Price per unit	100	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr>
88	Collateral market value	2000000	</OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData>
89	Haircut or margin	0	<LnData>
90	Collateral quality	INVG	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<UnqTradIdr>UTI3</UnqTradIdr> <MstrAgrmt>
92	Jurisdiction of the issuer	IT	<Tp> <Tp>GMRA</Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Tp> </MstrAgrmt>
94	Collateral type	GOVS	</RpTrad> </LnData>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<CollData> <RpTrad>
98	Action type	COLU	<AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877000</Id>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<ClssfctnTp>DBFTFR </ClssfctnTp>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
3	Event date	24/04/2020	</NmnlVal>
9	Master agreement	GMRA	</QtyOrNmnlVal>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<UnitPric>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Ptrg>100</Ptrg>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</UnitPric>
83	Collateral quantity or nominal amount	-2000000	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
84	Collateral unit of measure		<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Qty>INVG</Qty>
86	Price currency		<Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
87	Price per unit	100	<Issr>
88	Collateral market value	-2000000	<Id>
89	Haircut or margin	0	<JursdctnCtry>NL</JursdctnCtry>
90	Collateral quality	INVG	</Issr>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	ES	<Cd>GOVS</Cd>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	</Tp>
94	Collateral type	GOVS	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</Scty>
98	Action type	COLU	</AsstTp>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;IT00BH4HKS39&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt; DBFTFR &lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;NmnlVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Amt&gt; &lt;Sgn&gt;&gt;true&lt;/Sgn&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt; &lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt; &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt; &lt;Issr&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;IIIIIIIIIIIIIIIIIIII&lt;/LEI&gt; </pre>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbaġħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Id&gt; &lt;Jurisdiction&gt;IT&lt;/Jurisdiction&gt; &lt;/Issr&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvblForCollReuse&gt;true&lt;/AvblForCollReuse&gt;  &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXprCollstnInd&gt;true&lt;/NetXprCollstnInd&gt;  &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt;  &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNORST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt; &lt;MstrAgrmt&gt; &lt;Tp&gt; </pre>



**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbaġħad inklużi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Scty&gt; &lt;Id&gt;ES0010877643&lt;/Id&gt; &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTPR &lt;/ClssfctnTp&gt; &lt;QtyOrNmnlVal&gt; &lt;NmnlVal&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;101000000&lt;/Amt&gt; &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt; &lt;Ptrg&gt;103.03&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt; &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;- 2000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt; &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt; &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt; &lt;Issr&gt; &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE &lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;ES&lt;/JursdctnCtry&gt; &lt;/Issr&gt; &lt;Tp&gt; &lt;Cd&gt;GOVS&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... </pre>

**Tabella 96 - Espożizzjoni netta - Il-margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting b'ritorn ta' titoli ekwivalenti iżda mhux identiċi lill-fornitur tal-kollateral**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.5 Espożizzjoni netta – Il- margni ta' varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting (Table 97)

383. Dan l-eżempju huwa varjazzjoni tal-eżempji preċedenti li inkludew margni ta' varjazzjoni fi espożizzjoninetta b'titoli. It-tliet SFTs identifikati bil UTI1, UTI2 u bil-UTI3 huma kkollateralizzati b'titoli fil-livell tat-tranzazzjonijiet, filwaqt għal margni ta varjazzjoni, il-kontropartijiet, daħlu f' arrangament li jiprovdu flus kontanti. Il-fornitur tal-kollateral huwa dak li jagħti flus addizzjonali biex ikopri l-espożizzjoni.

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta' varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;OthrCtrPty&gt; &lt;Id&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/Id&gt; &lt;/OthrCtrPty&gt; &lt;OthrPtyData&gt; &lt;AgtLndr&gt; &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt; &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta' varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
86	Price currency		<UnqTradldr>UTI1</UnqTradldr>
87	Price per unit	100	<MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp>
88	Collateral market value	100000000	</Tp> </MstrAgrmt>
89	Haircut or margin	0	</RpTrad> </LnData>
90	Collateral quality	INVG	<CollData> <RpTrad>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AsstTp> <Scty>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<Id>DE0010877643</Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
94	Collateral type	GOVS	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
75	Type of the collateral component	SECU	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</UnitPric>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Issr> <Id>
86	Price currency		<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >
87	Price per unit	100	</Id>
88	Collateral market value	50000000	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr>
89	Haircut or margin	0	<Tp> <Cd>GOVS</Cd>
90	Collateral quality	INVG	</Tp>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta' varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</Scty>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
94	Collateral type	GOVS	</ClssfctnTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt Ccy="EUR">50000000</Amt>
98	Action type	COLU	</NmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Issr> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
9	Master agreement	GMRA	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</Issr> <Tp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	</Scty> </AsstTp>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
84	Collateral unit of measure		</RpTrad> </CollData>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	... </CollUpd>
86	Price currency		</Rpt> <Rpt>
87	Price per unit	100	<CollUpd> <CtrPtyData>

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f’sett ta’ netting**

No	Field	Example	XML Message
88	Collateral market value	50000000	<pre>&lt;CtrPtyData&gt;   &lt;RptgCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;</pre>
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	<pre>&lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;</pre>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	FR	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<pre>&lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;     &lt;AgtLndr&gt;</pre>
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<pre>&lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;</pre>
98	Action type	COLU	
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre>&lt;UnqTradldr&gt;UTI2&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;     &lt;RpTrad&gt;       &lt;AsstTp&gt;         &lt;Scty&gt;           &lt;Id&gt;FR0010877643&lt;/Id&gt;           &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR</pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender B	<pre>&lt;/ClssfctnTp&gt;</pre>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<pre>&lt;QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;NmnlVal&gt;     &lt;Amt       Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/Amt&gt;     &lt;/NmnlVal&gt;   &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;   &lt;UnitPric&gt;</pre>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f’sett ta’ netting**

No	Field	Example	XML Message
84	Collateral unit of measure		<Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<MktVal Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn>
87	Price per unit	100	<Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
88	Collateral market value	50000000	<Issr> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	<JurstdctnCtry>FR</JurstdctnCtry>
91	Maturity date of the security	22/04/2040	</Issr> <Tp>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>
94	Collateral type	MEQU	</Scty> </AsstTp>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
98	Action type	GOVS	</RpTrad> </CollData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	... </CollUpd>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>12345678901234500000</LEI>
9	Master agreement	GMRA	</Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	CASH	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI>
76	Cash collateral amount	2000000	</Id> </OthrCtrPty>

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f’sett ta’ netting**

No	Field	Example	XML Message
77	Cash collateral currency	EUR	<pre> &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt;     &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt; &lt;/OthrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI3&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;     &lt;AsstTp&gt;       &lt;Scty&gt;         &lt;Id&gt;NL0010877643&lt;/Id&gt;         &lt;ClssfctnTp&gt;DBFTFR       &lt;/ClssfctnTp&gt;       &lt;QtyOrNmnlVal&gt;         &lt;Qty&gt;50000000&lt;/Qty&gt;       &lt;/QtyOrNmnlVal&gt;       &lt;UnitPric&gt;         &lt;MntryVal&gt;           &lt;Amt             Ccy="EUR"&gt;10&lt;/Amt&gt;           &lt;/MntryVal&gt;         &lt;/UnitPric&gt;         &lt;MktVal           Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/MktVal&gt;         &lt;/MktVal&gt;       &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;       &lt;Qlty&gt;INVG&lt;/Qlty&gt;       &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;       &lt;Issr&gt;         &lt;Id&gt;           &lt;LEI&gt;DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD         &lt;/LEI&gt;         &lt;/Id&gt; </pre>
98	Action type	COLU	

**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta' varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f'sett ta' netting**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;JursdctnCtry&gt;NL&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;     &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt;   &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;     &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;     &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;     &lt;RpTrad&gt;       &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;       &lt;MstrAgrmt&gt;         &lt;Tp&gt;           &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt; </pre>



**Table 97 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni bi flus tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f’sett ta’ netting**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/Tp&gt; &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/RpTrad&gt; &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; &lt;RpTrad&gt; &lt;AsstTp&gt; &lt;Csh&gt; &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Amt&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;/RpTrad&gt; &lt;/CollData&gt; ... &lt;/CollUpd&gt;  &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>

5.4.7.6 Il-marġni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM

384. It-Tabella 98 tkompli telabora fuq l-eżempju inkluz fit-Table 97, iżda f’dan il-każ, l-element importanti li jintwera huwa li fl-aħħar tal-ġurnata m’hemmx aktar kollateral uzat bħala margni ta’ varjazzjoni għall-kollateralizzazzjoni fuq bażi ta’ espożizzjoni netta. Il-logika tar-rapportar hija simili għar-rapportar ta’ meta l-kollateral ikun ekwivalenti għal żero fit-taqsimha 5.4.4.

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inkluzi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollUpd&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;Id&gt; </pre>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – II- margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting. F'dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI1	<code>&lt;LEI&gt;12345678901234500000&lt;/LEI&gt;</code> <code>&lt;/Id&gt;</code> <code>&lt;/RptgCtrPty&gt;</code> <code>&lt;OthrCtrPty&gt;</code> <code>&lt;Id&gt;</code>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<code>&lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;</code> <code>&lt;/Id&gt;</code> <code>&lt;/OthrCtrPty&gt;</code> <code>&lt;OthrPtyData&gt;</code> <code>&lt;AgtLndr&gt;</code>
75	Type of the collateral component	SECU	
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<code>&lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;</code> <code>&lt;/AgtLndr&gt;</code> <code>&lt;/OthrPtyData&gt;</code> <code>&lt;/CtrPtyData&gt;</code> <code>&lt;/CtrPtyData&gt;</code> <code>&lt;LnData&gt;</code> <code>&lt;RpTrad&gt;</code> <code>&lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;</code>
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	
86	Price currency		<code>&lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;</code> <code>&lt;MstrAgrmt&gt;</code> <code>&lt;Tp&gt;</code> <code>&lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;</code> <code>&lt;/Tp&gt;</code> <code>&lt;/MstrAgrmt&gt;</code> <code>&lt;/RpTrad&gt;</code> <code>&lt;/LnData&gt;</code> <code>&lt;CollData&gt;</code> <code>&lt;RpTrad&gt;</code> <code>&lt;AsstTp&gt;</code> <code>&lt;Scty&gt;</code> <code>&lt;Id&gt;DE0010877643&lt;/Id&gt;</code>
87	Price per unit	100	
88	Collateral market value	100000000	
89	Haircut or margin	0	
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2030	
92	Jurisdiction of the issuer	DE	
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	
95	Availability for collateral reuse	TRUE	
75	Type of the collateral component	SECU	<code>Ccy="EUR"&gt;100000000&lt;/Amt&gt;</code> <code>&lt;/NmnlVal&gt;</code> <code>&lt;/QtyOrNmnlVal&gt;</code> <code>&lt;UnitPric&gt;</code> <code>&lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt;</code> <code>&lt;/UnitPric&gt;</code>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<MktVal Ccy="EUR">100000000</MktVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
86	Price currency		
87	Price per unit	100	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN</LEI> >  </Id>
88	Collateral market value	50000000	<JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry>
89	Haircut or margin	0	</Issr> <Tp>
90	Collateral quality	INVG	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	<AvlblForCollReuse>>true</AvlblForCollReuse>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	</Scty> <Scty>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
94	Collateral type	GOVS	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<NmnlVal> <Amt
98	Action type	COLU	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal> </QtyOrNmnlVal>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	<UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg> </UnitPric>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<MktVal>50000000</MktVal>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty>
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI2	<Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
3	Event date	24/04/2020	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI>
9	Master agreement	GMRA	</Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<JursdctnCtry>FR</JursdctnCtry>

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – II- margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting. F'dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
75	Type of the collateral component	SECU	</Issr> <Tp>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	<Cd>GOVS</Cd> </Tp>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty>
83	Collateral quantity or V nominal amount	50000000	</AsstTp>
84	Collateral unit of measure		<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	</RpTrad> </CollData>
86	Price currency		... </CollUpd>
87	Price per unit	100	</Rpt> <Rpt> <CollUpd>
88	Collateral market value	50000000	<CtrPtyData> <CtrPtyData>
89	Haircut or margin	0	<RptgCtrPty> <Id>
90	Collateral quality	INVG	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
91	Maturity date of the security	22/04/2030	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
92	Jurisdiction of the issuer	FR	<Id>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
94	Collateral type	GOVS	</OthrCtrPty> <OthrPtyData>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	<AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData>
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</CtrPtyData> </CtrPtyData>
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	<LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	<UnqTradlDr>UTI2</UnqTradlDr> <MstrAgrmt>

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
1	Unique Transaction Identifier ('UTI')	UTI3	<Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp>
3	Event date	24/04/2020	</MstrAgrmt> </RpTrad>
9	Master agreement	GMRA	</LnData> <CollData>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	<RpTrad> <AsstTp>
75	Type of the collateral component	SECU	<Scty> <Id>FR0010877643</Id> <ClssfctnTp>DBFTFR
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal> <NmnlVal> <Amt
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	Ccy="EUR">50000000</Amt> </NmnlVal>
83	Collateral quantity or nominal amount	50000000	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>100</Ptrg>
84	Collateral unit of measure		</UnitPric> <MktVal
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	Ccy="EUR">50000000</MktVal>
86	Price currency		
87	Price per unit	100	<HrcutOrMrgn>0</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty>
88	Collateral market value	50000000	<Issr> <Id>
89	Haircut or margin	0	<LEI>FFFFFFFFFFFFFFFFFFFFFF</LEI> </Id>
90	Collateral quality	INVG	
91	Maturity date of the security	22/04/2040	<JurstdctnCtry>FR</JurstdctnCtry> </Issr>
92	Jurisdiction of the issuer	NL	<Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	
94	Collateral type	GOVS	<AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse> </Scty>
95	Availability for collateral reuse	TRUE	</AsstTp>
98	Action type	COLU	<NetXpsrCollstnInd>true</NetXpsrCollstnInd>

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – II- margni ta' varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f'sett ta' netting. F'dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
1.3	Reporting counterparty	LEI of counterparty A	</RpTrad> </CollData> ...
1.11	Other counterparty	LEI of counterparty B	</CollUpd>
1.18	Agent lender	{LEI} of agent lender F	</Rpt> <Rpt> <CollUpd> <CtrPtyData> <CtrPtyData> <RptgCtrPty> <Id>
3	Event date	24/04/2020	
9	Master agreement	GMRA	<LEI>12345678901234500000</LEI> </Id>
73	Collateralisation of net exposure	TRUE	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty> <Id>
75	Type of the collateral component	CASH	
76	Cash collateral amount	0	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </Id>
77	Cash collateral currency	EUR	</OthrCtrPty> <OthrPtyData> <AgtLndr>
98	Action type	COLU	<LEI>BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB</LEI> </AgtLndr> </OthrPtyData> </CtrPtyData> </CtrPtyData> <LnData> <RpTrad> <EvtDt>2020-04-24</EvtDt>  <UnqTradIdr>UT13</UnqTradIdr> <MstrAgrmt> <Tp> <Tp>GMRA</Tp> </Tp> </MstrAgrmt> </RpTrad> </LnData> <CollData> <RpTrad> <AsstTp> <Scty> <Id>NL0010877643</Id>  <ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp> <QtyOrNmnlVal>

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – II- margni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;NmnlVal&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/Amt&gt;   &lt;/NmnlVal&gt; &lt;/QtyOrNmnlVal&gt; &lt;UnitPric&gt;   &lt;Ptrg&gt;100&lt;/Ptrg&gt; &lt;/UnitPric&gt;    &lt;MktVal Ccy="EUR"&gt;50000000&lt;/MktVal&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;Qty&gt;INVG&lt;/Qty&gt;   &lt;Mtrty&gt;2030-04-22&lt;/Mtrty&gt;   &lt;Issr&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;DDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDDD &lt;/LEI&gt;    &lt;/Id&gt;  &lt;JursdctnCtry&gt;NL&lt;/JursdctnCtry&gt;   &lt;/Issr&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Cd&gt;MEQU&lt;/Cd&gt; &lt;/Tp&gt;  &lt;AvlblForCollReuse&gt;true&lt;/AvlblForCollReuse&gt;   &lt;/Scty&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;  &lt;HrcutOrMrgn&gt;0&lt;/HrcutOrMrgn&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;Rpt&gt;   &lt;CollUpd&gt;   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;CtrPtyData&gt;   &lt;RptgCtrPty&gt;   &lt;Id&gt; </pre>

**Tabella 98 – Espożizzjoni netta – Il- margni ta’ varjazzjoni tar-repos ikkollateralizzati inizjalment fil-livell tat-tranzazzjonijiet u mbagħad inklużi f’sett ta’ netting. F’dak il-jum partikolari, il-pożizzjoni ma tkunx varjabbli u ma jkun meħtieġ l-ebda VM**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;   &lt;Id&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/Id&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;   &lt;OthrPtyData&gt;   &lt;AgtLndr&gt;  &lt;LEI&gt;BBBBBBBBBBBBBBBBBBBB&lt;/LEI&gt;   &lt;/AgtLndr&gt;   &lt;/OthrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;/CtrPtyData&gt;   &lt;LnData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;EvtDt&gt;2020-04-24&lt;/EvtDt&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;   &lt;Tp&gt;   &lt;Tp&gt;GMRA&lt;/Tp&gt;   &lt;/Tp&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/LnData&gt;   &lt;CollData&gt;   &lt;RpTrad&gt;   &lt;AsstTp&gt;   &lt;Csh&gt;   &lt;Amt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/Amt&gt;   &lt;/Csh&gt;   &lt;/AsstTp&gt;  &lt;NetXpsrCollstnInd&gt;true&lt;/NetXpsrCollstnInd&gt;   &lt;/RpTrad&gt;   &lt;/CollData&gt;   ...   &lt;/CollUpd&gt;   &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxRpt&gt; </pre>



#### 5.4.8 Kollateral imħallas minn qabel għal SLB

385. Meta tkun qed tiġi rrapportata l-allokazzjoni tal-kollateral għal espożizzjoni netta, l-aġġornament tal-kollateral jenħtieġ li jispeċifika l-LEIs tal-kontropartijiet, il-ftehim prinċipali, id-data tal-valur tal-kollateral u l-allokazzjoni speċifika tal-kollateral, sabiex l-aġġornament tal-kollateral ikun jista' jiġi assoċjat mal-SFTs eżistenti. Il-kamp "Data tal-valur tal-kollateral" (Kamp 2.74) huwa applikabbli fil-kuntest ta' Repos, BSB/SBB u SLB.
386. Id-data tal-avveniment tispeċifika d-data tas-saldu mistennija tal-kollateral. Billi jitqabblu l-LEIs tal-kontropartijiet, il-ftehim prinċipali, u l-kampijiet tad-data tar-rapport kummerċjali originali u pprovduti fl-aġġornament tal-kollateral, huwa possibbli li jiġi identifikat għal liema negozji japplika l-aġġornament tal-kollateral għal ammont pendenti nett. Fl-eżempju muri fit-Tabella 99, jenħtieġ li l-kollateral jiġi rrapportat abbażi tas-saldu mistenni li seħħ fit-23/04/2020, speċifikata bħala d-"Data tal-Avveniment" (Kamp 2.3). Id-"Data tal-valur tal-kollateral" (Kamp 2.74) tispeċifika d-data li minnha japplika l-aġġornament tal-kollateral għas-self pendenti (jiġifieri l-kollateral ma jibqax "imħallas minn qabel" mill-24/04/2020). Għalhekk, biex jiġi ddeterminat għal liema SFTs japplika l-aġġornament tal-kollateral, id-data tal-valur tal-kollateral tkun relatata mad-data tal-valur u mad-data tal-maturità tas-SFTs li jkollhom l-istess LEIs tal-kontropartijiet u l-istess ftehim prinċipali.

Tabella 99 - Kollateral imħallas minn qabel			
No	Field	Example	XML Message
3	Event date	2020-04-23	<SctiesFincgRptgTxRpt> <TradData>
73	Collateralisation of net exposure	true	<Rpt> <CollUpd>
74	Value date of the collateral	2020-04-24	... <CtrPtyData>
78	Identification of a security used as collateral	{ISIN}	... </CtrPtyData> <LnData>
79	Classification of a security used as collateral	{CFI}	<SctiesLndg> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> </SctiesLndg>
83	Collateral quantity or nominal amount	100000000	</LnData> <CollData>
84	Collateral unit of measure		<SctiesLndg> <Collsd>
85	Currency of collateral nominal amount	EUR	<CollValDt>2020-04-24</CollValDt>
86	Price currency		<AsstTp> <Scty> <Id>DE0010877643</Id>
87	Price per unit	102	<ClssfctnTp>DBFTFR</ClssfctnTp>
88	Collateral market value	102000000	<QtyOrNmnlVal> <NmnlVal>
89	Haircut or margin	2	<Amt Ccy="EUR">100000000</Amt>

Tabella 99 - Kollateral imħallas minn qabel			
No	Field	Example	XML Message
90	Collateral quality	INVG	</NmnlVal>
91	Maturity date of the security	2030-04-22	</QtyOrNmnlVal> <UnitPric> <Ptrg>102</Ptrg> </UnitPric>
92	Jurisdiction of the issuer	DE	<MktVal
93	LEI of the issuer	{LEI} of the issuer	Ccy="EUR">102000000</MktVal>
94	Collateral type	GOVS	<HrcutOrMrgn>2</HrcutOrMrgn> <Qty>INVG</Qty> <Mtrty>2030-04-22</Mtrty> <Issr> <Id>
95	Availability for collateral reuse	true	<LEI>NNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNNN </LEI>  </Id>  <JursdctnCtry>DE</JursdctnCtry> </Issr> <Tp> <Cd>GOVS</Cd> </Tp>  <AvlblForCollReuse>true</AvlblForCollReuse>  </Scty> </AsstTp> </Collsd> </SctiesLndg> </CollData>  ... </CollUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxRpt>

#### 5.4.9 Il-portafoll ta' tranzazzjonijiet ikklirjati

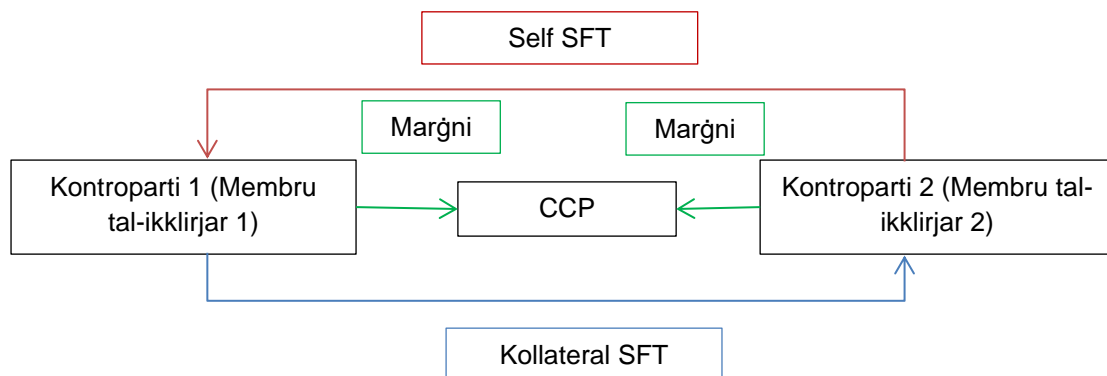
387. Meta jirrapportaw il-Kamp 2.97 (Kodiċi tal-portafoll), il-kontropartijiet jenħtieġ li jiżguraw li jużaw il-kodiċi b'mod konsistenti fir-rapporti tagħhom. Jekk il-kodiċi jidentifika portafoll li jikkollateralizza tranzazzjonijiet li jinkludu wkoll derivattivi, il-kontropartijiet jenħtieġ li jużaw l-istess kodiċi użat għar-rapportar skont l-EMIR.
388. Barra minn hekk, il-valur tal-Kodiċi tal-portafoll ma għandux bżonn ikun uniku b'mod universali iżda jeħtieġ li jintuża b'mod konsistenti. Peress li l-Kamp 2.97 fih valur li ma jaqbilx, il-valur ma għandux għalfejn ikun ġie miftiehem bejn iż-żewġ kontropartijiet fit-tranzazzjoni.

## 5.5 Data dwar il-marġni

389. Id-*data* inkluża f'din it-taqsima jenftieg li tiġi rrapportata mill-kontropartijiet kollha li l-SFTs tagħhom ikunu ġew ikklirjati ċentralment sakemm dawn il-kontropartijiet ma jkunux soġġetti għad-delegazzjoni obligatorja skont l-Artikolu 4(2) f'dak il-każ jenftieg li tkun l-entità speċifikata f'dak l-Artikolu li tkun dik li tirrapporta.
390. Sabiex ikunu jistgħu jintużaw is-servizzi ta' CCP, kemm is-CM 1 kif ukoll is-CM 2 jiddepożitaw marġni għas-CCP. Il-marġni huwa kompost mill-marġni inizjali u mill-marġni ta' varjazzjoni<sup>16</sup>. Il-marġni li jigi iddepożitat mill membri tal-ikklijar għal mas-CCP ma għandu l-ebda relazzjoni diretta mal-kollateral tal-SFT. Is-CCP tuża l-marġni biex tkopri r-riskji kollha li jirriżultaw mit-tranzazzjonijiet li tikklirja għall-membri tal-ikklijar rispettivi. Il-marġni li l-membri tal-ikklijar jiddepożitaw għas-CCP jista' jkopri wkoll riskji li jirriżultaw minn tranzazzjonijiet li mhumiex SFTs, bħal tranzazzjonijiet f'derivattivi.

### 5.5.1 Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li jkunu membri tal-ikklijar

Każ 1. Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li jkunu membri tal-ikklijar



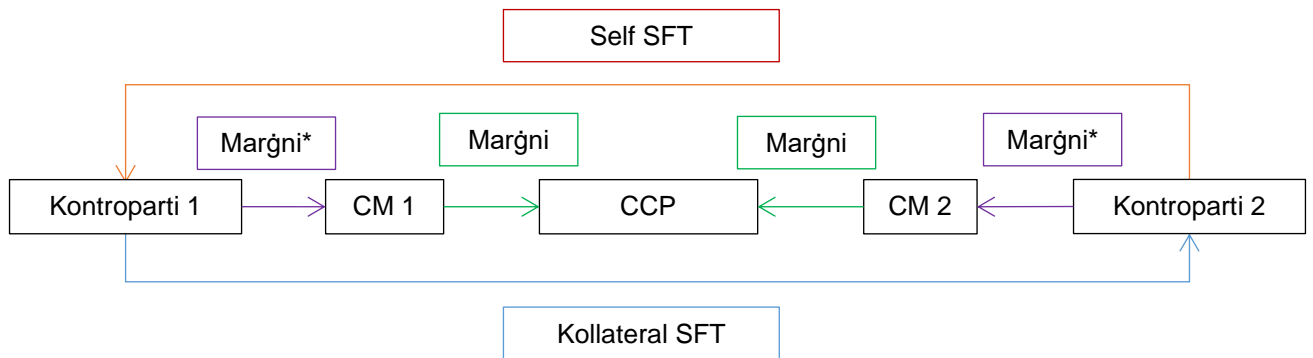
391. Meta kontroparti ma tkunx membru tal-ikklijar, il-marġni li tipprovdni lill-membru tal-ikklijar (ara "marġni\*" fil-każ 2 ta' hawn taħt) jista' jkun differenti mill-marġni pprovdut mill-membru tal-ikklijar lis-CCP.

<sup>16</sup> Jista' jkun hemm ukoll marġni eċċessiv, li jkun il-parti tal-kollateral li taqbez il-livell meħtieġ.

## 5.5.2 Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li ma jkunux membri tal-ikklijjar

- 

**Każ 2. Is-CCP tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet li ma jkunux membri tal-ikklijjar**



## 5.5.3 Rapportar ta' informazzjoni dwar il-marġni

392. F'każ li jkun hemm it-tielet tip ta' skambju ta' marġni, jenħtieġ li l-kontropartijiet jaqblu u jirrapportaw b'mod konsistenti bħala Marġni Inizjali jew Marġni ta' Varjazzjoni.
393. Marġni Inizjali, Marġni ta' Varjazzjoni u kollateral eċċessiv huma lkoll irrapportati f'ċifra waħda, li tikonsisti mill-valur gross (qabel it-telf impost) tal-klassijiet kollha tal-assi riċevuti/iddepożitati/mirhuna. F'każ li ma jkun hemm l-ebda derivativ fil-portafoll li jiġi kklirjat, huwa rakkomandat li tiġi segwita l-munita bażi tas-CCP, madankollu, jekk ikun hemm derivattivi rapportabbli skont l-EMIR, jenħtieġ li tintuża l-istess munita.
394. L-informazzjoni dwar il-marġni hija applikabbli biss għal SFTs ikklirjati minn CCP. Fil-każ muri fit-Table 100, l-entità tuża l-istess portafoll għall-kollateralizzazzjoni bħal taħt l-EMIR. Il-kontroparti relatriċi, il-Kontroparti J, li hija wkoll membru tal-kklirjar, tuża s-servizzi ta' rapportar delegat pprovduti mill-Kontroparti D. Din tirrapporta l-ammont ta' EUR 1,000,000 depożitat bħala marġni inizjali u l-ammont ta' EUR 300,000 bħala marġni ta' varjazzjoni depożitat mas-CCP O. Il-kontroparti tirrapporta wkoll kollateral eċċessiv ta' EUR 100,000.

Table 100 – Data dwar il-marġni			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxMrgnDataRpt> <TradData> <Rpt> <TradUpd> <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting Counterparty	{LEI} of counterparty J	

Table 100 – Data dwar il-margni			
No	Field	Example	XML Message
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty J	<CtrPty> <RptgCtrPty>
6	Other counterparty	{LEI} of CCP O	<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC </LEI>
7	Portfolio code	EMIRSFTRC ODE1	</RptgCtrPty> <OthrCtrPty>
8	Initial margin posted	1000000	<LEI>BBBBBBBBBBB1111111111</LEI>
9	Currency of the initial margin posted	EUR	</OthrCtrPty> <NttyRspnsblForRpt>
10	Variation margin posted	300000	<LEI>CCCCCCCCCCCCCCCCCCCC </LEI>
11	Currency of the variation margins posted	EUR	</NttyRspnsblForRpt> <RptSubmitgNtty>
12	Initial margin received		<LEI>11223344556677889900</LEI>
13	Currency of the initial margin received		</RptSubmitgNtty> </CtrPty>
14	Variation margin received		<CollPrftlId>EMIRSFTRCODE1</CollPrftlId> >
15	Currency of the variation margins received		<PstdMrgnOrColl> <InitMrgnPstd Ccy="EUR">1000000</InitMrgnPstd>
16	Excess collateral posted	100000	<VartnMrgnPstd Ccy="EUR">300000</VartnMrgnPstd>
17	Currency of the excess collateral posted	EUR	<XcssCollPstd Ccy="EUR">100000</XcssCollPstd>
18	Excess collateral received		</PstdMrgnOrColl> <RcvdMrgnOrColl>
19	Currency of the excess collateral received		... </RcvdMrgnOrColl> </TradUpd> </Rpt>
20	Action type	MARU	</TradData> </SctiesFincgRptgTxMrgnDataRpt>

## 5.6 I-użu mill-ġdid ta' data, ri-investment ta' flus kontanti u sorsi ta' finanzjament

395. Kif enfasizzat fl-RTS, il-logika li hija l-bażi tat-Tabella 4 tal-Anness għat-TS dwar ir-rapportar hija differenti mit-tabelli l-oħrajn, u mhix se tintuża għar-rikonċiljazzjoni, peress li din l-informazzjoni ma tistax tkun marbuta ma' tranżazzjonijiet individwali. Minflok, l-użu mill-ġdid ta' kollateral mhux fi flus, ri-investment ta' kollateral fi flus u s-sorsi ta' finanzjament għandhom jiġu rrapportati bħala aggregati fil-livell tal-entità relatriċi.

396. Barra minn hekk, jekk id-*data* dwar l-użu mill-ġdid tal-kollateral, ri-investment tal-flus kontanti jew is-sorsi ta' finanzjament tkun irrapportata f'punti differenti fiż-żmien, l-ewwel rapport biss jenħtieġ li jiġi rrapportat bit-tip ta' azzjoni "NEWT" għal kombinazzjoni partikolari ta' kontroparti relatriċi u entità responsabbli għar-rapportar, irrispettivament minn liema kampijiet hija tinkludi. Ir-rapporti sussegwenti għal dik il-kombinazzjoni jenħtieġ li jsiru bit-tip ta' azzjoni rilevanti.

### 5.6.1 Użu mill-ġdid tal-kollateral

397. L-użu mill-ġdid tal-kollateral għandu jiġi rrapportat bl-użu tal-formula miftiehma fil-qafas tal-FSB<sup>17</sup> u inkluż fl-RTS. Il-parteciċipanti fis-suq, normalment ma jagħmlux distinzjoni bejn l-assi tagħhom stess u l-kollateral li jkunu rċivew mill-kontropartijiet (dment li t-titoli tal-kollateral ikunu eliġibbli biex jergghu jintuzgħu). Għalhekk, l-intuwizzjoni wara l-formola tal-FSB hija li l-entitajiet għandhom jipprovdu stima tal-ammont ta' kollateral li huma jkunu qed jergghu juzaw, abbażi tas-sehem ta' kollateral li jkunu rċivew meta mqabbla mal-assi tagħhom stess.

398. L-obbligu ta' rapportar japplika biss għal SFTs, li jfisser li t-titoli tal-kollateral depożitati jew riċevuti minn tranżazzjonijiet oħra jaqgħu barra mill-kamp ta' applikazzjoni. Fi kliem ieħor, il-kollateral depożitat għal skopijiet ta' margni fi tranżazzjonijiet ta' derivati jew kwalunkwe tranżazzjoni oħra li ma jaqawx fil-kamp ta' applikazzjoni tal-SFTR, kif diskuss fit-Taqsima 4.2.1, jenħtieġ li ma jiġux inklużi fil-formula.

399. Dan ifisser ukoll li l-komponenti tal-formula tal-użu mill-ġdid jenħtieġ li ma jiġux irrapportati separatament lill-ESMA. Minflok, l-entitajiet responsabbli mir-rapportar jenħtieġ li jipprovdu biss l-istima li tirriżulta mill-applikazzjoni tal-formula fil-livell tal-ISIN.

400. Meta ma jkun seħħ l-ebda użu mill-ġdid, il-kamp tar-rapportar jenħtieġ li jithalla vojta. Meta l-kollateral ma jerġax jintuża, il-kamp 'Aggornament tal-użu mill-ġdid (REUU), għandha tigi rrapportata bhalha "0".

401. Jekk hemm delegazzjoni tar-rapportar, il-kontroparti li jkun gie delegat ir-rapportar, mhux responsabbli biex jirrapporta l-ammont stmat rigward l-użu mill-ġdid tal-kollateral. L-NFCs huma responsabbli għall-kalkolu tal-użu mill-ġdid stmat huma stess u jipprovdu l-istima lill-kontroparti inkarigata mir-rapportar puntwali.

402. Jekk il-kontropartijiet jippreferu jirrapportaw l-użu mill-ġdid propju minflok l-użu mill-ġdid stmat, jistgħu jagħmlu dan.

403. Fil-qafas tal-FSB, it-terminu "kollateral" huwa ddefinit b'mod wiesa' mill-funzjoni ekonomika tiegħu, jiġifieri li għandu jinftiehem bħala titoli, irrispettivament mill-istruttura legali tat-tranżazzjoni. F'termini tal-kamp ta' applikazzjoni, dan ifisser li l-*kollateral riċevut, eliġibbli għal użu mill-ġdid* jiġbor:

- a. titoli riċevuti bħala kollateral f'riakkwist invers u BSB;
- b. titoli meħuda b'self fi tranżazzjonijiet ta' teħid b'self ta' titoli;

---

<sup>17</sup> FSB Non-cash collateral re-use: Measure and metrics. <http://www.fsb.org/wp-content/uploads/Non-cash-Collateral-Re-Use-Measures-and-Metrics.pdf>

- c. titoli riċevuti bħala kollateral fi tranżazzjonijiet ta' għoti ta' self ta' titoli;
  - d. titoli riċevuti bħala kollateral addizzjonali biex jiġu ssodisfati r-rekwiżiti tal-marġni ta' varjazzjoni li joriġinaw minn SFTs.
404. Il-marġini inizjali mirhuna li huma iżolati u immobilizzati (eż. fil-kuntest tad-derivattivi), u għalhekk mhux eliġibbli għall-użu mill-ġdid, jenħtieġ li ma jiġux inklużi fl-istima.
405. Fl-għoti ta' marġni b'self, l-eliġibbiltà ta' kollateral għall-użu mill-ġdid ma tiddependix biss mit-tip ta' arranġament tal-kollateral użat għat-tranżazzjoni iżda anki mil-limiti kuntrattwali ("limitu ta' riipotekazżjoni") miftiehem bejn is-sensar prinċipali u l-klijent tiegħu. Dan il-limitu jiġi kkalkolat bħala perċentwal fiss tal-ammont pendenti ta' self b'marġni ta' kuljum. Sabiex il-kollateral jerġa' jintuża, it-titoli li għandhom dritt għal riipotekazżjoni jeħtieġ li l-ewwel jiġu ttrasferiti mill-kont tal-klijent għall-kont tas-sensar prinċipali stess fi ħdan il-limitu. L-ESMA tipproponi li għall-kalkolu tal-formula tal-użu mill-ġdid, *il-kollateral riċevut, eliġibbli għall-użu mill-ġdid* jenħtieġ li jeskludi titoli tal-kollateral li ma jistgħux jiġu ttrasferiti għall-kont proprju tas-sensar prinċipali minħabba l-limitu kuntrattwali fuq ir-riipotekazżjoni. It-titoli ddepożitati iżda mhux assenjati jenħtieġ li jiġu inklużi. L-inklużjoni ta' tali titoli tkun twassal għal stima eċċessiva tal-ammont ta' kollateral li jkun fil-fatt ikun qed jintuża mill-ġdid.
406. B'mod simili, il-kollateral iddepożitat ikopri:
- a. titoli ddepożitati bħala kollateral f'repos u f'SBB
  - b. titoli mogħtija b'self
  - c. titoli ddepożitati bħala kollateral fi tranżazzjonijiet ta' teħid b'self ta' titoli
  - d. titoli ddepożitati bħala kollateral biex jiġu ssodisfati r-rekwiżiti tal-marġni ta' varjazzjoni li joriġinaw minn SFTs.
407. Kwalunkwe titoli riċevuta jew iddepożitata bħala parti minn tranżazzjonijiet li jaqgħu barra mill-kamp ta' applikazzjoni tal-SFTR, inklużi SFTs li jinvolvu kontropartijiet tas-SEBC, jenħtieġ li jiġu esklużi mill-formula tal-użu mill-ġdid.
408. Is-CCPs jenħtieġ li jeskludu mill-istimi tal-użu mill-ġdid tagħhom it-titoli tal-kollateral li jiġu ttrasferiti bejn il-membri tal-ikklijer bħala parti mill-attivitajiet ta' klijer ċentrali tagħhom. Dan jikkonċerna kemm il-komponenti tal-"Kollateral riċevut" kif ukoll tal-"Kollateral użat mill-ġdid" tal-formula. Dawn it-titoli tal-kollateral ma jerġgħux jintużaw mis-CCP per se, peress li t-trasferiment ta' titoli pjuttost jirrifletti l-proċess ta' novazzjoni li jseħħ meta kontroparti ċentrali tinfilza lilha nnifisha bejn iż-żewġ kontropartijiet oriġinali. It-titoli tal-kollateral riċevuti bħala marġni jenħtieġ li jiġu inklużi fl-istimi, kif applikabbli, u s-CCPs huma mistennija jirrapportaw kwalunkwe użu mill-ġdid li jseħħ bħala parti mill-attivitajiet l-oħra tagħhom. Dan jinkludi operazzjonijiet tat-teżor u kwalunkwe tip ieħor ta' faċilità jew ta' mekkaniżmu (eż. self ta' titoli invers) li s-CCPs jista' jkollhom fis-seħħ.
409. Rigward il-metrika tal-użu mill-ġdid tal-kollateral<sup>189</sup> inkluża fil-qafas tal-FSB, dawn se jiġu kkalkolati direttament mill-awtoritajiet nazzjonali jew globali abbażi tal-użu mill-ġdid tal-kollateral irrapportat mill-entitajiet. Għar-rata tal-użu mill-ġdid, l-awtoritajiet ser ikollhom bżonn jikkalkolaw id-denominatur abbażi tad-*data* rrapportata mill-entitajiet fit-Tabella 2.

---

<sup>189</sup> Ara t-taqsima 4 tal-qafas tal-FSB dwar l-użu mill-ġdid ta' kollateral mhux fi flus.



5.6.1.1 L-użu mill-ġdid ta' titoli minn FC jew minn NFC mhux SME mingħajr delega ta' rapportar

410. It-Tabella 101 turi każ li fih il-kontroparti B tirrapporta l-valur tat-titoli użati mill-ġdid b'l-ISIN IT00BH4HKS39 fl-ammont ta' EUR 10,000,000.

Tabella 101 – L-użu mill-ġdid ta' titoli minn FC jew minn NFC mhux SME mingħajr delega ta' rapportar			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
6	Type of collateral component	SECU	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>
7	Collateral component	{ISIN}	<NttyRspnsblForRpt>
8	Value of reused collateral		<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
9	Estimated reuse of collateral	10000000	</CtrPtyData> <CollCmpnt>
10	Reused collateral currency	EUR	<Scty> <ISIN>IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd
18	Action type	REUU	Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt>  ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>



5.6.1.2 L-użu mill-ġdid ta' titoli minn FC jew minn NFC mhux SME b'delega ta' rapportar

411. It-Tabella 102 turi l-każ li fih il-kontroparti A tiddelega r-rapportar lill-kontroparti B. Hija tirrapporta l-valur tat-titoli użati mill-ġdid b'l-ISIN IT00BH4HKS39 fl-ammont ta' EUR 10,000,000.

Tabella 102 – L-użu mill-ġdid ta' titoli minn FC jew minn NFC mhux SME b'delega ta' rapportar			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData> <Rpt> <CollReuseUpd> ... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData> <RptSubmitgNtty> <LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty> <LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty> <NttyRspnsblForRpt> <LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt> </CtrPtyData> <CollCmpnt> <Scty> <ISIN> IT00BH4HKS39</ISIN> <ReuseVal> <Estmtd Ccy="EUR">10000000</Estmtd> </ReuseVal> </Scty> </CollCmpnt> <EvtDt>2020-04-23</EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

### 5.6.1.3 L-użu mill-ġdid ta' titoli minn NFC SME b'kontroparti waħda

412. It-Tabella 103 turi l-każ li fih il-kontroparti Ċ tkun NFC SME u tkun ikkonkludiet SFTs ma' entità waħda biss - il-kontroparti B (FC). Il-kontroparti B tirrapporta l-valur tat-titoli użati mill-ġdid b'l-ISIN IT00BH4HKS39 fl-ammont ta' EUR 10,000,000.

Tabella 103 – L-użu mill-ġdid ta' titoli minn NFC SME b'kontroparti waħda			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...       &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptSubmitgNtty&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;           &lt;/RptSubmitgNtty&gt;           &lt;RptgCtrPty&gt;             &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHJKLM&lt;/LEI&gt;             &lt;/RptgCtrPty&gt;             &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;               &lt;LEI&gt;                 ABCDEFGHIJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;               &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;             &lt;/CtrPtyData&gt;             &lt;CollCmpnt&gt;               &lt;Scty&gt;                 &lt;ISIN&gt;IT00BH4HKS39&lt;/ISIN&gt;                 &lt;ReuseVal&gt;                   &lt;Estmtd                     Ccy="EUR"&gt;10000000&lt;/Estmtd&gt;                   &lt;/ReuseVal&gt;                 &lt;/Scty&gt;               &lt;/CollCmpnt&gt;               &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt;               ...             &lt;/CollReuseUpd&gt;           &lt;/Rpt&gt;         &lt;/TradData&gt;       &lt;/SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

#### 5.6.1.4 L-użu mill-ġdid ta' titoli minn NFC SME b'diversi kontropartijiet

413. It-Tabella 104 u t-Tabella 105 fihom l-informazzjoni li jenftieg li tiġi rrapportata fir-rigward tal-użu mill-ġdid minn NFC SME b'diversi kontropartijiet. F'dan l-eżempju, hemm żewġ tabelli. Madankollu, jista' jkun hemm tabelli daqs kemm ikun hemm kontropartijiet li magħhom l-NFC SME tkun daħlet f'SFTs u sussegwentement tkun użat mill-ġdid il-kollateral.
414. F'dan il-każ, il-kontroparti Ċ hija NFC SME, u kkonkludiet SFTs ma' żewġ entitajiet - il-kontroparti B u l-kontroparti D. Il-kontroparti B tirrapporta l-valur tat-titoli użati mill-ġdid b'l-ISIN IT00BH4HKS39 fl-ammont ta' EUR 10,000,000 fit-Tabella 104. Il-kontroparti D tirrapporta l-valur tat-titoli użati mill-ġdid b'l-ISIN FR00BH4HKS3 fl-ammont ta' EUR 2,000,000 fit-Tabella 105.

Tabella 104 – L-użu mill-ġdid ta' titoli minn NFC SME b'diversi kontropartijiet			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollReuseUpd&gt; ... &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHJKLM&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; &lt;Scty&gt; &lt;ISIN&gt; IT00BH4HKS39&lt;/ISIN&gt; &lt;ReuseVal&gt; &lt;Estmtd Ccy="EUR"&gt;10000000&lt;/Estmtd&gt; &lt;/ReuseVal&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	10000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

Tabella 104 – L-użu mill-ġdid ta’ titoli minn NFC SME b’diversi kontropartijiet			
No	Field	Example	XML Message
			<pre>&lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt;</pre>

Tabella 105 – L-użu mill-ġdid ta’ titoli minn NFC SME b’diversi kontropartijiet (2)			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T18:41:07Z	<pre>&lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollReuseUpd&gt; ... &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHIJK&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; &lt;Scty&gt; &lt;ISIN&gt; FR00BH4HKS3&lt;/ISIN&gt; &lt;ReuseVal&gt; &lt;Estmtd Ccy="EUR"&gt;2000000&lt;/Estmtd&gt; &lt;/ReuseVal&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt;2020-04-23&lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt;</pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty D	
6	Type of collateral component	SECU	
7	Collateral component	{ISIN}	
8	Value of reused collateral		
9	Estimated reuse of collateral	2000000	
10	Reused collateral currency	EUR	
18	Action type	REUU	

## 5.6.2 Ri-investment tal-kollateral fi flus kontanti

415. Jenħtieg li l-kontropartijiet jirrapportaw investment mill-ġdid tal-kollateral fi flus meta flus kontanti jintużaw bħala kollateral fi tranżazzjonijiet ta' SLB u jiġu investiti mill-ġdid, jew direttament mis-sellief (riċevitur ta' kollateral) jew f'isem is-sellief minn aġent. Ir-rapportar ta ri-investment mill-gdid huwa irrISPettivament mit-tip ta' kontroparti finanzjarja involuta, eż. sensar finanzjarju, negozjant, kumpanija tal-investment, eċċ. Huwa relatat mal-pożizzjoni ta' dawn fl-SFTs rilevanti.
416. It-tip ta' ri-investment (Kamp 4.12) u l-ammont ta' flus ri-investiti (Kamp 4.13) jenħtieg li jitqassmu skont il-munita tal-kollateral fi flus investit mill-ġdid (Kaxxa 4.14). Peress li l-kontropartijiet huma mistennija jirrapportaw rata ta' ri-investment unika mingħajr tqassim skont il-munita, ir-rata ta' ri-investment (Kamp 4.11) jenħtieg li tiġi kkalkolata bħala r-rata medja ponderata bbażata fuq l-ammont ta' flus ri-investiti (Kamp 4.13) wara konverżjoni fil-munita tal-flus ri-investiti (Kamp 4.14).
417. Il-flus riċevuti għal skopijiet ta' marġinazzjoni f'SFTs ikklirjati mhux ċentralment u sussegwentement ri-investiti ukoll huma fil-kamp ta' applikazzjoni.
418. Flus riċevuti minn self ta' marġini u sussegwentement ri-investiti jenħtieg li ma jiġux irrapportati bħala ri-investment ta' kollateral fi flus. Għar-rapportar ta' kollateral fi flus fil-kuntest tas-self b'marġni, ara t-Taqsima 5.3.16.
419. F'każ fejn il-kontroparti relatriċi ma tkunx tista' tiddistingwi bejn il-flus tagħha stess u l-flus riċevuti bħala kollateral fi flus, l-ammont ta ri-investment mill-ġdid fi flus jenħtieg li jiġi kkalkolat billi tintuża l-istess metodoloġija bħall-kollateral mhux fi flus.
420. Il-kollateral fi flus riċevut mis-CCPs (bħala parti mir-rekwiżiti ta' proviżjonament ta' marġni) u l-investimenti mill-ġdid ta' kollateral fi flus diġà huma disponibbli pubblikament mill-Żvelar Kwantitattiv Pubbliku tas-CPMI-IOSCO<sup>19</sup>. Għalkemm ir-rapportar skont l-SFTR iseħħ fuq bażi ta' kuljum (u mhux fuq bażi trimestrali kif huwa l-każ għall-lżvelar Kwantitattiv Pubbliku), il-livell komparabbli ta' granularità u t-tip ta' informazzjoni miġbura ma jiġġustifikawx rapportar addizzjonali. Għalhekk, l-investment mill-ġdid tal-kollateral fi flus tas-CCP huwa eskluż.
421. Fl-aħħar nett, fir-rigward tar-rapportar ta' ri-investment tal-kollateral fi flus, jenħtieg li l-kontropartijiet iqisu wkoll kwalunkwe gwida sussegwenti jew kjarifika pprovduta f'dan il-kuntest mill-FSB.

### 5.6.2.1 Investment mill-ġdid ta' flus minn FC jew minn NFC mhux SME mingħajr delega tar-rapportar

422. It-Tabella 106 turi l-każ li fih il-kontroparti B tirrapporta ir ri-investment ta' flus tagħha stess ta' EUR 100,000 b'rata ta' 1.5 % fis-suq repo.

---

<sup>19</sup> CPMI-IOSCO, Frar 2015, "Public quantitative disclosure standards for central counterparties": <https://www.bis.org/cpmi/publ/d125.pdf>

Tabella 106 - Investment mill-ġdid ta' flus minn FC jew minn NFC mhux SME mingħajr delega tar-rapportar			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...       &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptSubmitgNtty&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/RptSubmitgNtty&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;CtrPtyData&gt;           &lt;CollCmpnt&gt;             &lt;Csh&gt;               &lt;RinvstdCsh&gt;                 &lt;Tp&gt;REPM&lt;/Tp&gt;                 &lt;RinvstdCshAmt                   Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/RinvstdCshAmt&gt;                 &lt;/RinvstdCsh&gt;               &lt;/Csh&gt;               &lt;CshRinvstmtRate&gt;1.5&lt;/CshRinvstmtRate&gt;             &lt;/Csh&gt;           &lt;/CollCmpnt&gt;           &lt;EvtDt&gt;             2020-04-23           &lt;/EvtDt&gt;           ...         &lt;/CollReuseUpd&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TradData&gt;   &lt;/SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
11	Reinvestment Rate	1.5	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	

#### 5.6.2.2 Ri-Investment ta' flus minn FC jew minn NFC mhux SME b'delega tar-rapportar

423. It-Tabella 107 turi l-każ li fih il-kontroparti A tiddelega r-rapportar tari-investment ta' flus tagħha lill-kontroparti B. Il-kontroparti B tirrapporta ri-investment ta' flus ta' EUR 100,000 b'rata ta' 1% fis-suq repo.

**Tabella 107 - Investment mill-ġdid ta' flus minn FC jew minn NFC mhux SME b'delega tar-rapportar**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty A	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty A	<LEI>ABCDEFGHJKLMNOPQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>12345678901234500000</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>12345678901234500000</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh> <RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt> </RinvstdCsh>
18	Action type	REUU	<CshRinvstmtRate>1</CshRinvstmtRate> </Csh> </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> ... </CollReuseUpd> </Rpt> </TradData>  </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

### 5.6.2.3 Ri-Investment ta' flus minn NFC SME b'kontroparti waħda

424. It-Tabella 108 turi l-każ li fih il-kontroparti Ċ hija NFC SME, u kkonkludiet SFTs ma' entità waħda biss - il-kontroparti B. Il-kontroparti B tirrapporta l-investment mill-ġdid tal-kollateral fi flus ta' EUR 100,000 b'rata ta' 1% fis-suq repo.

Tabella 108 - Investment mill-ġdid ta' flus kontanti minn NFC SME b'kontroparti waħda			
No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...       &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;       &lt;CtrPtyData&gt;         &lt;RptSubmitgNtty&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/RptSubmitgNtty&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;           &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHJKLM&lt;/LEI&gt;         &lt;/RptgCtrPty&gt;         &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;           &lt;LEI&gt;ABCDEFGHJKLMNOPQRST&lt;/LEI&gt;         &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;/CtrPtyData&gt;         &lt;CollCmpnt&gt;           &lt;Csh&gt;             &lt;RinvstdCsh&gt;               &lt;Tp&gt;REPM&lt;/Tp&gt;               &lt;RinvstdCshAmt&gt;                 Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/RinvstdCshAmt&gt;               &lt;/RinvstdCsh&gt;             &lt;/Csh&gt;             &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&gt;           &lt;/Csh&gt;         &lt;/CollCmpnt&gt;         &lt;EvtDt&gt;           2020-04-23         &lt;/EvtDt&gt;         ...       &lt;/CollReuseUpd&gt;     &lt;/Rpt&gt;   &lt;/TradData&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} OF counterparty B	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	
11	Reinvestment Rate	1	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	



**Tabella 108 - Investiment mill-ġdid ta' flus kontanti minn NFC SME b'kontroparti waħda**

No	Field	Example	XML Message
			</SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

#### 5.6.2.4 Ri-Investment mill-ġdid ta' flus minn NFC SME b'diversi kontropartijiet

425. It-Tabella 109 u t-Tabella 110 fihom l-informazzjoni li jenħtieġ li tiġi rrapportata fir-rigward tar-ri-investment ta' kollateral minn NFC SME b'diversi kontropartijiet. F'dan l-eżempju, hemm żewġ tabelli. Madankollu, jista' jkun hemm tabelli daqs kemm ikun hemm kontropartijiet li magħhom l-NFC SME tkun daħlet f'SFTs u sussegwentement tkun ri-investiet il-kollateral fi flus.
426. F'dan il-każ, il-kontroparti Ċ hija NFC SME, u kkonkludiet SFTs ma' żewġ entitajiet - il-kontroparti B u l-kontroparti D. Il-kontroparti B tirrapporta l-ammont ta' EUR 100,000 bħala kollateral fi flus ri-investiti fit-Tabella 109. Il-kontroparti D tirrapporta l-ammont ta' EUR 100,000 bħala kollateral fi flus li gew ri-investiti fit-Tabella 110.

**Tabella 109 - Investiment mill-ġdid ta' flus minn NFC SME b'diversi kontropartijiet (1)**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <CollReuseUpd>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	... <RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	<CtrPtyData> <RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
11	Reinvestment Rate	1	<LEI>123456789ABCDEFGHIJK</LEI> </RptgCtrPty>
12	Type of re-invested cash investment	REPM	<NttyRspnsblForRpt>
13	Re-invested cash amount	100000	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
14	Re-invested cash currency	EUR	</CtrPtyData> <CollCmpnt> <Csh>
18	Action type	REUU	<RinvstdCsh> <Tp>REPM</Tp> <RinvstdCshAmt Ccy="EUR">100000</RinvstdCshAmt>

**Tabella 109 - Investment mill-ġdid ta' flus minn NFC SME b'diversi kontropartijiet (1)**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;/RinvstdCsh&gt; &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt; 2020-04-23 &lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>

**Tabella 110 - Investment mill-ġdid ta' flus kontanti minn NFC SME b'diversi kontropartijiet (2)**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt; &lt;Rpt&gt; &lt;CollReuseUpd&gt; ... &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt; &lt;CtrPtyData&gt; &lt;RptSubmitgNtty&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/RptSubmitgNtty&gt; &lt;RptgCtrPty&gt; &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHIJK&lt;/LEI&gt; &lt;/RptgCtrPty&gt; &lt;NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt; &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt; &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; &lt;Csh&gt; &lt;RinvstdCsh&gt; &lt;Tp&gt;REPM&lt;/Tp&gt; &lt;RinvstdCshAmt Ccy="EUR"&gt;100000&lt;/RinvstdCshAmt&gt; &lt;/RinvstdCsh&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI2} of counterparty D	
11	Reinvestment Rate	1	
12	Type of re-invested cash investment	REPM	
13	Re-invested cash amount	100000	
14	Re-invested cash currency	EUR	
18	Action type	REUU	

**Tabella 110 - Investiment mill-ġdid ta' flus kontanti minn NFC SME b'diversi kontropartijiet (2)**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;CshRinvstmtRate&gt;1&lt;/CshRinvstmtRate&gt;   &lt;/Csh&gt;   &lt;/CollCmpnt&gt;   &lt;EvtDt&gt;                                 2020-04-23                                 &lt;/EvtDt&gt;                                 ...   &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt;  &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>

### 5.6.3 Użu mill-ġdid ta' kollateral żero mhux fi flus u ri-investment ta' flus

427. It-Tabella 111 turi r-rapportar tal-kampijiet f'każ li la jkun hemm użu mill-ġdid ta' kollateral mhux fi flus u lanqas ri-investment ta' kollateral fi flus. Għalhekk, jenħtieġ li l-kontropartijiet jirrapportaw bħalma jagħmlu fit-Tabella 111.

428. F'dan il-każ, il-Kamp 12 tat-Tabella 4 tal-RTS "Tip ta' investment ta' flus ri-investiti" jenħtieġ li jiġi rrapportat bħala "ieħor/oħrajn".

**Tabella 111 – L-użu mill-ġdid tal-kollateral żero fi flus**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; &lt;TradData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;CollReuseUpd&gt;       ...     &lt;RptgDtTm&gt;2020-04-22T16:41:07Z&lt;/RptgDtTm&gt;     &lt;CtrPtyData&gt;       &lt;RptSubmitgNtty&gt;         &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptSubmitgNtty&gt;       &lt;RptgCtrPty&gt;         &lt;LEI&gt;123456789ABCDEFGHIJK&lt;/LEI&gt;       &lt;/RptgCtrPty&gt;       &lt;NttyRspnsblForRpt&gt;         &lt;LEI&gt;11223344556677889900&lt;/LEI&gt;       &lt;/NttyRspnsblForRpt&gt;       &lt;/CtrPtyData&gt;     &lt;/CollCmpnt&gt; </pre>
2	Event date	2020-04-23	
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty D	
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty C	
5	Entity responsible for the report	{LEI2} of counterparty D	
6	Type of collateral component	CASH	
12	Type of re-invested cash investment	OTHR	
13	Re-invested cash amount	0	
14	Re-invested cash currency	EUR	

**Tabella 111 – L-użu mill-ġdid tal-kollateral żero fi flus**

No	Field	Example	XML Message
			<pre> &lt;Csh&gt;   &lt;RinvstdCsh&gt;     &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;RinvstdCshAmt Ccy="EUR"&gt;0&lt;/RinvstdCshAmt&gt;   &lt;/RinvstdCsh&gt; &lt;/Csh&gt; &lt;/CollCmpnt&gt; &lt;EvtDt&gt;                                      2020-04-23 _&lt;/EvtDt&gt; ... &lt;/CollReuseUpd&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TradData&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt&gt; </pre>

#### 5.6.4 Sorsi ta' finanzjament

429. Il-kampijiet li jappartjenu għal sorsi ta' finanzjament biss jenħtieġ li jiġu rrapportati meta jkun hemm self b'marġni jew valur qasir tas-suq pendenti. Jenħtieġ li l-kontropartijiet relaturi jew l-entitajiet responsabbli għar-rapportar jipprovdu din l-informazzjoni fil-livell tal-kontropartijiet relaturi, u mhux fil-livell tat-tranzazzjonijiet individwali.
430. It-Tabella 112 turi l-każ li fih il-kontroparti B tirrapporta ammont ta' EUR 5,000,000 bħala sorsi ta' finanzjament mis-suq repo sabiex tiffinanzja s-self b'marġni.

**Tabella 112 - Sorsi ta' finanzjament**

No	Field	Example	XML Message
1	Reporting timestamp	2020-04-22T16:41:07Z	<SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt> <TradData>
2	Event date	2020-04-23	<Rpt> <Crrctn>
3	Report submitting entity	{LEI} of counterparty B	<RptgDtTm>2020-04-22T16:41:07Z</RptgDtTm> <CtrPtyData>
4	Reporting counterparty	{LEI} of counterparty B	<RptSubmitgNtty>
5	Entity responsible for the report	{LEI} of counterparty B	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptSubmitgNtty> <RptgCtrPty>
15	Funding sources	REPO	<LEI>ABCDEFGHIJKLMNQRST</LEI> </RptgCtrPty>

Tabella 112 - Sorsi ta' finanzjament			
No	Field	Example	XML Message
16	Market value of the funding sources	5000000	<NttyRspnsblForRpt>
17	Funding sources currency	EUR	<LEI>ABCDEFGHIJKLMN</LEI> </NttyRspnsblForRpt>
18	Action type	REUU	</CtrPtyData> <CollCmpnt> ... </CollCmpnt> <EvtDt> 2020-04-23 </EvtDt> <FndgSrc> <Tp>REPO</Tp> <MktVal Ccy="EUR">5000000</MktVal> </FndgSrc> </Crrctn> </Rpt> </TradData> </SctiesFincgRptgTxReusdCollDataRpt>

## 6 Feedback dwar ir-rifjut

431. L-Artikolu 1(1) RTS dwar il-ġbir ta' *data* jipprovdi l-kontrolli differenti li jehtieg li TR iwettaq biex jiżgura l-korrettezza u l-kompletezza tad-*data* dwar l-SFT irrapportata skont l-Artikolu 4 SFTR.
432. Jenhtieg li t-TR jipprovdi feedback dwar ir-rifjut f'konformità mal-kategoriji ta' rifjut li ġejjin:
- Validazzjoni ta' skema ta' sottomissjoni skont l-Artikolu 1(1)(b) RTS dwar il-ġbir ta' *data*
  - Awtorizzazzjoni/permess ta' entità li tippreżenta rapport skont l-Artikolu 1(1)(c) RTS dwar il-ġbir ta' *data*
  - Validazzjoni loġika ta' sottomissjoni skont l-Artikoli 1(1)(d) sa 1(1)(j) RTS dwar il-ġbir ta' *data*
  - Ir-regoli tan-negozju jew il-validazzjoni tal-kontenut ta' sottomissjoni skont l-Artikolu 1(1)(k) RTS dwar il-ġbir ta' *data* u inkluzi fir-regoli ta' validazzjoni u kif previst f'dawn il-Linji Gwida
433. Ta' min jinnota li l-awtentikazzjoni ta' entità titwettaq mit-TR fil-ħin tal-konnessjoni mas-sistema tat-TR; B'hekk, ma jiġi pprovdut l-ebda feedback speċifiku dwar ir-rifjut.
434. Jenhtieg li t-TR jivverifika l-konformità tal-fajl mal-iskema XML (is-sintassi tal-fajl sħiħ u rapporti dwar l-SFTs speċifiċi). Jekk il-fajl ma jkunx konformi, il-fajl kollu (it-tranzazzjonijiet kollha inkluzi fil-fajl) jiġi rrifjutat, u r-raġuni tkun li l-fajl huwa "korrott".

435. Billi l-Artikolu 1(c) tal-RTS dwar il-ġbir ta' *data* jiddikjara li dan il-kontroll jenħtieġ li jsir bħala parti mill-verifika tar-rapporti magħmula lit-TR u filwaqt li r-relazzjoni ta' għoti ta' permessi tista' tiġi stabbilita fl-onboarding, l-awtorizzazzjoni sabiex isir rapport jenħtieġ li tiġi vverifikata wkoll fil-livell ta' sottomissjoni u jenħtieġ li TR jirrifjuta kwalunkwe sottomissjoni li ma tgħaddix minn din il-verifika b'messaġġ ta' feedback xieraq.
436. Jenħtieġ li t-TRs jużaw il-messaġġ XML rilevanti tal-ISO 20022 sabiex jipprovdu l-feedback dwar il-validazzjoni lill-entitajiet li jkunu onboarded għal dak it-TR. Jenħtieġ li t-TRs jużaw il-kodicijiet inkluzi fil-kampijiet tar-rapportar meta jikkomunikaw rifjuti lill-kontropartijiet.
437. Wara li jirċievu notifika rigward ir-rifjut, il-kontropartijiet relaturi jew l-ERR jenħtieġ li, direttament jew inkella permezz ta' RSE, jipprezentaw rapporti korretti u kompluti sal-iskeda ta' żmien tar-rapportar kif iddefinita fl-Artikolu 4(1) SFTR.
438. Meta fajl ikun fih 3 tranżazzjonijiet, iżda t-tranżazzjonijiet ma jgħaddux il-validazzjonijiet, l-istatistika turi l-fajl kif aċċettat bi 3 tranżazzjonijiet rifjutati.
439. Meta fajl tad-*data* sottomess mill-kontroparti relatriċi, l-entità responsabbli għar-rapportar, jew l-entità li tissottometti r-rapport ikun fiha żball serju fl-iskema u t-tranżazzjonijiet ma jkunux jistgħu jiġu vvalidati, dan jiġi rrapportat bħala rifjut ta' fajl 1.
440. B'segwitu għall-informazzjoni ta' hawn fuq, it-TRs se jipprovdu lil kull kontroparti relatriċi, entità responsabbli għar-rapportar jew entità li tippreżenta r-rapport, kif applikabbli, b'rapport ta' tmiem il-ġurnata (auth.084.001.01) li jkun fih l-informazzjoni li ġejja:

Tabella 113 – Feedback dwar ir-rifjut			
No.	Field	Details to be reported	XML Message
1	Number of files received	Numeric values	<pre> &lt;SctiesFincgRptgTxStsAdv&gt;   &lt;TxRptStsAndRsn&gt;     &lt;Rpt&gt;       &lt;RptSttstcs&gt;         &lt;TtlNbOfRpts&gt;2&lt;/TtlNbOfRpts&gt;       &lt;/Rpt&gt;     &lt;/TxRptStsAndRsn&gt;   &lt;/SctiesFincgRptgTxStsAdv&gt; </pre>
2	No. of files accepted	Numeric values	
3	No. of files rejected	Numeric values	
4	File identification	Textual value	
5	Rejection reason	Error code	
6	Rejection description	Error description	
7	Number of SFTs received	Numeric values	
8	Number of SFTs accepted	Numeric values	
9	Number of SFT s rejected	Numeric values	
10	Identification of the SFT		
11	Reporting counterparty	Table A Field 3	
12	UTI	Table B Field 1	
13	Other counterparty	Table A Field 11	
14	Master agreement type	Table B Field 9	
15	Rejection reason	Error codes	
16	Rejection description	Error description	<pre> &lt;TtlNbOfRptsAccptd&gt;1&lt;/TtlNbOfRptsAccptd&gt; &lt;TtlNbOfRptsRjctd&gt;1&lt;/TtlNbOfRptsRjctd&gt;   &lt;NbOfRptsRjctdPerErr&gt;     &lt;DtldNb&gt;1&lt;/DtldNb&gt;     &lt;RptSts&gt;       &lt;MsgRptld&gt;ReportID&lt;/MsgRptld&gt;       &lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt;       &lt;DtldVldtnRule&gt;         &lt;Id&gt;RuleID&lt;/Id&gt;         &lt;Desc&gt;Rule description&lt;/Desc&gt;         &lt;SchmeNm&gt;           &lt;Cd&gt;1&lt;/Cd&gt;         &lt;/SchmeNm&gt;       &lt;/DtldVldtnRule&gt;     &lt;/RptSts&gt;   &lt;/NbOfRptsRjctdPerErr&gt; &lt;/RptSttstcs&gt; </pre>

		<pre> &lt;TxSttscs&gt;   &lt;TtlNbOfTxS&gt;2&lt;/TtlNbOfTxS&gt;  &lt;TtlNbOfTxSAccptd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxSAccptd&gt;  &lt;TtlNbOfTxSRjctd&gt;1&lt;/TtlNbOfTxSRjctd&gt;   &lt;NbOfTxSRjctd&gt;     &lt;TxId&gt;       &lt;Tx&gt;         &lt;RptgCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI1&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;MstrAgrmt&gt;     &lt;Tp&gt;       &lt;Tp&gt;OTHR&lt;/Tp&gt;     &lt;/Tp&gt;     &lt;Vrsn&gt;2019&lt;/Vrsn&gt;   &lt;/MstrAgrmt&gt; &lt;/Tx&gt; &lt;/TxId&gt; &lt;Sts&gt;RJCT&lt;/Sts&gt; &lt;DtldVldtnRule&gt;   &lt;Id&gt;RuleID&lt;/Id&gt;   &lt;Desc&gt;Rule description&lt;/Desc&gt; &lt;/DtldVldtnRule&gt; &lt;/NbOfTxSRjctd&gt; &lt;/TxSttscs&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/TxRptStsAndRsn&gt; &lt;/SctiesFincgRptgTxStsAdv&lt; </pre>
--	--	---

441. Dan jiżgura li f'każ li l-kontroparti relatriċi jew l-entità responsabbli għar-rapportar ma tirrapportax direttament lit-TR, iżda jkollha kont ta' viżwalizzazzjoni biss, huma jenħtieġ li jkunu kapaċi jkollhom fehim dettaljat dwar il-konformità tagħhom mal-obbligu ta' rapportar skont l-SFTR.

## 7 Feedback dwar ir-rikonċiljazzjoni

442. Meta jsir il-proċess ta' rikonċiljazzjoni bejn TRs tas-self bejn pari ta' TRs, imbagħad (i) irrikonċilja s-self fuq fil-kampijiet rikonċiljabbli tas-self u b'mod parallel (ii) irrikonċilja l-kollateral fil-kampijiet rikonċiljabbli tal-kollateral. Għalhekk, il-kollateral ma jiġix akkoppjat irrispettivament minn jekk huwiex kollateral ibbażat fuq il-kummerċ jew kollateral ta' espożizzjoni netta. Jenħtieġ li self biss jitqiegħed f'pari, u jitqabbel il-kollateral assoċjat

mas-self kemm għall-kollateral ibbażat fuq il-kummerċ kif ukoll għall-kollateral ibbażat fuq l-espożizzjoni netta. Jenħtieġ li t-TRs ma jithalltux ma' kollateral ta' pari u, f'dak il-każ, jekk naħa waħda ma tippovdix kollateral ta' espożizzjoni netta, f'dak il-każ kull assi tal-kollateral jiġi rrapportat fir-rapport dwar l-Istatus tar-Rikonċiljazzjoni tar-Riżultati taħt "Mhux Imlaqqa", u l-Istat ta' Rikonċiljazzjoni tal-Kollateral ikun "Mhux Irrikonċiljat".

Tabella 114 - Kategoriji ta' rikonċiljazzjoni	
Reconciliation categories	Allowable values
Reporting type	Single-sided/dual-sided
Reporting requirement for both counterparties	Yes/No
Pairing Status	Paired/unpaired
Loan reconciliation status	Reconciled/not reconciled
Collateral reconciliation status	Reconciled/not reconciled
Further modifications:	Yes/No

443. Wara r-riċevuta u l-aċċettazzjoni, wara verifika, ta' messaġġ bit-tip ta' azzjoni "EROR", jenħtieġ li t-TR ineħhi SFT partikolari mir-ikonċiljazzjoni b'effett immedjat, jiġifieri, miċ-ċiklu ta' rikonċiljazzjoni li jkun imiss.
444. Barra minn hekk, l-ebda SFT ma tista' terġa' titqajjem, u għalhekk SFT jenħtieġ li tiġi eskluża minn rikonċiljazzjoni 30 jum wara d-data ta' maturità jew it-terminazzjoni bikrija tagħha, jiġifieri rrapportar bit-tip ta' azzjoni "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija", jew "Komponent ta' pożizzjoni" f'konformità mal-kundizzjonijiet skont l-Artikolu 2(2)(h) tal-RTS dwar il-verifika. Barra minn hekk, fil-każ ta' rikonċiljazzjoni tad-dettalji tal-kollateral, dawn il-messaġġi jvarjaw mill-messaġġi ta' self fis-sens li ma hemm l-ebda data ta' maturità. Għal kollateral ibbażat fuq skoperturi netti, dan ifisser li d-data tiegħu hija relatata mad-data tan-naħa tas-self tal-SFT. Għalhekk, TR jenħtieġ li jfittex jirrikonċilja din l-informazzjoni sa tletin jum wara t-terminazzjoni jew il-maturità tal-aħħar self li huwa inkluż fil-kollateralizzazzjoni tal-iskopertura netta. Barra minn hekk, l-istatus ta' rikonċiljazzjoni tal-kollateral għal kollateral ta' skopertura netta jiġi ripetut għall-SFTs kollha inklużi fil-kollateralizzazzjoni ta' skopertura netta.
445. Meta jkun hemm rekwiżit ta' rrapportar għaž-żewġ kontropartijiet, jenħtieġ li dawn jiżguraw li l-SFTs irrapportati jkollhom status ta' akkoppjament bħala "Akkoppjati", status ta' rikonċiljazzjoni tas-self bħala "Irrikonċiljati" u "Status ta' rikonċiljazzjoni tal-kollateral bħala "Irrikonċiljati".
446. Sabiex dan jiġi ffaċilitat, it-TRs ser ikunu qed jipprovduhom ir-rapport li ġej li jkun fih informazzjoni dettaljata dwar l-istatus tar-ikonċiljazzjoni ta' kull SFT li jkunu rrapportaw u li jkun soġġett għar-ikonċiljazzjoni:

Tabella 115 - Feedback dwar ir-Rikonċiljazzjoni				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
1	Reporting counterparty	Unique key	Table A Field 3	<SciesFincgRptgRcncltnStsAdv>



Tabella 115 - Feedback dwar ir-Rikonciljazzjoni				
No.	Field		Details to be reported	XML Message
2	UTI		Table B Field 1	<pre> &lt;RcncltnData&gt;   &lt;Rpt&gt;     &lt;PaigrRcncltnSts&gt;  &lt;DtldNbOfRpts&gt;2&lt;/DtldNbOfRpts&gt;   &lt;DtldSts&gt;PARD&lt;/DtldSts&gt; &lt;/PaigrRcncltnSts&gt;   &lt;RcncltnRpt&gt;    ...   &lt;Txld&gt;     &lt;RptgCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;1234567890123450000&lt;/LEI&gt;   &lt;/RptgCtrPty&gt;   &lt;OthrCtrPty&gt;  &lt;LEI&gt;ABCDEFGHIJKLMNQRST&lt;/LEI&gt;   &lt;/OthrCtrPty&gt;  &lt;UnqTradldr&gt;UTI10&lt;/UnqTradldr&gt;   &lt;/Txld&gt;   &lt;Modfd&gt;&gt;true&lt;/Modfd&gt;   &lt;RcncltnSts&gt;   &lt;RptgData&gt;   &lt;NotMtchd&gt;   &lt;CtrPty1&gt;  &lt;LEI&gt;AAAAAAAAAAAAAAAAAAAA&lt;/LEI&gt;   &lt;/CtrPty1&gt;   &lt;CtrPty2&gt;  &lt;LEI&gt;EEEEEEEEEEEEEEEEEEEE&lt;/LEI&gt;   &lt;/CtrPty2&gt;   &lt;MtchgCrit&gt;   &lt;LnMtchgCrit&gt;   &lt;TermntnDt&gt;     &lt;Val1&gt;2019-04-20     &lt;Val2&gt;2019-04-21   &lt;/TermntnDt&gt; &lt;/LnMtchgCrit&gt;   &lt;CollMtchgCrit&gt;   &lt;CmpntTp&gt;   &lt;Scty&gt; </pre>
3	Other counterparty		Table A Field 11	
4	Master agreement type		Table B Field 9	
	Report status		Paired/Reconciled	
	Reporting timestamp	Information on the last reporting timestamp pertaining to the SFT that is reconciled	Table A Field 1	
	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	
	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	
	Matching status		True/False	
	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported	Loan fields of Table 1 of RTS on data verification	
	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	

**Tabella 115 - Feedback dwar ir-Rikonċiljazzjoni**

No.	Field		Details to be reported	XML Message
	Reportable collateral fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported	Collateral fields of Table 1 of RTS on data verification	<pre> &lt;Qty&gt; &lt;Val1&gt;1234&lt;/Val1&gt; &lt;Val2&gt;1243&lt;/Val2&gt; &lt;/Qty&gt; &lt;/Scty&gt; &lt;/CmpntTp&gt; &lt;/CollMtchgCrit&gt; &lt;/MtchgCrit&gt; &lt;/NotMtchd&gt; &lt;/RptgData&gt; &lt;/RcncltnSts&gt; &lt;/RcncltnRpt&gt; &lt;/Rpt&gt; &lt;/RcncltnData&gt;  &lt;/SciesFincgRptgRcncltnStsAdv&gt; </pre>

447. Wara t-tneħħija tal-SFTs mir-rikonċiljazzjoni, dawn l-SFTs jenħtieġ li jitneħħew ukoll mir-rapporti ta' rikonċiljazzjoni pprovduti lill-kontropartijiet u lill-awtoritajiet. Jenħtieġ li t-TRS iżommu fis-sistemi tagħhom l-aħħar status ta' rikonċiljazzjoni ta' dawn l-SFTs.

## 8 Feedback dwar kollateral nieqes

448. Jenħtieġ li jiġi indikat jekk l-SFT hijiex ikkollateralizzata jew le. Meta l-SFT tkun ikkollateralizzata, l-informazzjoni dwar il-kollateral trid tiġi pprovduta malli tkun magħrufa.
449. Meta l-informazzjoni dwar il-kollateral tkun għadha mhix magħrufa fil-ħin tar-rapportar, id-dettalji tal-kollateral speċifiku, jiġifieri l-Kampijiet 2.75 sa 2.94, ma jiġux ippopolati. Minflok jiġi ppopolat il-Kamp 2.96, jew b'ISIN validu tal-basket tal-kollateral jew b"NTAV". Ir-rapport tal-SFT jiġi aċċettat.
450. Fi tmiem il-ġurnata, skont l-Artikolu 3(c) tal-RTS tal-ġbir ta' *data*, it-TR għandu jiġġenera rapport li jkun fih "l-Identifikaturi Uniċi ta' Tranżazzjoni (UTI) tal-SFTs li għalihom il-Kamp 72 tat-Tabella 2 tal-Anness I għar-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) 2019/363 ikun irrapportat bħala "falz", u l-informazzjoni dwar il-kollateral fil-Kampijiet 73 sa 96 tal-istess Tabella tkun għadha ma ġietx irrapportata". Minhabba li l-informazzjoni dwar komponenti ta' kollateral individwali tinsab fil-Kampijiet 2.75 sa 2.94, biex tfakkar lill-entitajiet biex jipprovdu informazzjoni speċifika dwar il-kollateral, it-TR jenħtieġ li jiġġenera r-"Rapport dwar il-Kollateral Nieqes" li fih il-UTIs ta' SFTs li l-kontroparti rrapportat bħala kkollateralizzati u li għalihom ġie rrapportat il-Kamp 2.96 biss.
451. Minhabba li huwa mistenni li għal SFTs tal-istess ġurnata ma jkunx allokat kollateral, sabiex jiġu żgurati l-effiċjenza u l-utilizzabilità ta' din id-*data* mill-kontropartijiet, jenħtieġ li t-TRS jinkludu f'dan ir-rapport l-SFTs li jissodisfaw il-kundizzjonijiet kollha ta' hawn taħt:
- SFTs li fihom il-Kamp 2.72 ikun ippopolat b"falz" u jiġi rrapportat biss il-Kamp 2.96;

- b. SFTs li fihom il-parti tad-data tal-kronogramma tal-eżekuzzjoni u d-data ta' maturità jew id-data ta' terminazzjoni jkunu differenti;
- c. SFTs li huma soġġetti għar-rikonċiljazzjoni.

## 9 Kif tiġi pprovduta informazzjoni lill-awtoritajiet

### 9.1 Skedi ta' żmien biex jiġi stabbilit l-aċċess għad-data

- 452. Fir-rigward tal-puntwalità tal-aċċess għad-data, jenħtieġ li t-TRs jistabbilixxu l-proċessi interni tagħhom b'tali mod li, skont l-Artikolu 4(1)(f), awtorità jkollha aċċess dirett u immedjat għad-dettalji tal-SFTs fi żmien tletin jum wara li tkun ipprezentat it-talba tagħha għall-istabbiliment tal-aċċess.
- 453. It-TRs jenħtieġ li jużaw l-informazzjoni pprovduta mill-awtoritajiet fil-formola rilevanti pprovduta fl-RTS dwar l-aċċess għad-data. Id-data tal-SFT dwar fergħat u sussidjarji jenħtieġ li tiġi pprovduta lill-awtoritajiet ukoll billi titqies id-data eżistenti tar-relazzjoni tal-LEI.
- 454. Barra minn hekk, meta jipprovdu aċċess għal data rrapportata mill-kontropartijiet skont l-Artikolu 4 tal-SFTR, jenħtieġ li t-TRs jinkludu fil-fajls dwar l-attività u l-istat SFTs irrapportati fil-livell tat-tranzazzjonijiet u tal-pożizzjonijiet.
- 455. Fir-rigward tar-rekwiżiti tal-Artikolu 4(2)(k) RTS dwar l-aċċess għad-data, l-aċċess jenħtieġ li jiġi pprovdut għall-komoditajiet, f'każ li l-Istati Membri rilevanti ta' dawk ikunu identifikabbli.
- 456. Fir-rigward tar-rekwiżiti tal-Artikolu 4(2)(n) RTS dwar l-aċċess għad-data, fejn l-aċċess għal SFTs jenħtieġ li jingħata fil-munita maħruġa mill-bank ċentrali, jenħtieġ li l-aċċess għad-data jkopri l-kampijiet kollha mhux ta' valutazzjoni fejn tintuża l-munita. Jekk diversi awtoritajiet joħorġu l-istess munita, bħalma huwa l-każ tal-euro, kollha jenħtieġ li jkollhom aċċess għal dawk l-SFTs.
- 457. Fir-rigward tar-rekwiżiti dwar l-Artikolu 4(2)(o) RTS dwar l-aċċess għad-data, fejn l-aċċess jenħtieġ li jiġi pprovdut lill-SFTs relatati mal-parametri referenzjarji li huma pprovduti minn amministratur li għalih l-entità fl-Artikolu 12(2) SFTR għandha mandat, jenħtieġ li t-TR jiżgura li jirċievi l-informazzjoni li tiċċertifika l-kapaċità tal-amministraturi rilevanti għal dawk il-parametri referenzjarji.

### 9.2 Arranġamenti operazzjonali għall-aċċess għad-data

- 458. Fir-rigward tad-dettalji tal-SFTs irrapportati f'konformità mat-Tabelli 1 sa 4 tal-Anness għall-RTS dwar ir-rapportar, inkluzi l-aħħar stati kummerċjali ta' SFTs li ma jkunux immaturaw jew li ma kinux is-soġġetti għal rapporti b'tipi ta' azzjoni "Żball", "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija", jew "Komponent ta' pożizzjoni" kif imsemmi fil-Kamp 98 tat-Tabella 2 tal-Anness I għall-ITS dwar ir-rapportar, jenħtieġ li t-TRs jużaw il-mudelli XML li ġejjin.
- 459. Il-messaġġi ta' attività kummerċjali rilevanti huma auth.052.001.01 (kontroparti, self u kollateral), auth.070.001.01 (marġini), auth.071.001.01 (użu mill-ġdid tal-kollateral). Il-

messagġi rilevanti tal-istat huma 079.001.01 (kontroparti, self u kollateral), auth.085.001.01 (marġni), auth.086.001.01 (użu mill-ġdid tal-kollateral). Dawn il-mudelli ġew aġġornati fir-rigward tal-aġġornament u tal-kjarifika dwar il-mudelli relatati ma' (i) Rapportar ta' Kollateral ta' Repo u ta' Kollateral ta' BSB, (ii) Rapportar ta' Kollateral ta' Self b'Marġni, (iii) Rapportar ta' Kollateral ta' Skopertura Netta, (iv) Assi ta' Kollateral Multipli.

460. Barra minn hekk, l-istess mudelli għandhom jintużaw meta t-TRs iħejju r-rispons kemm għall-mistoqsijiet rikorrenti kif ukoll għal dawk ad-hoc għal *data* dwar self u kollateral. It-TRs mhumiex meħtieġa jipprovdu aċċess għad-*data* dwar il-marġni u l-użu mill-ġdid permezz ta' mistoqsijiet ad hoc, peress li ma hemm l-ebda kamp li jistgħu jsiru mistoqsijiet dwaru għal kwalunkwe wieħed miż-żewġ rapporti.

Tabella 116 – Rapport tal-SFT – <i>data</i> dwar il-kontroparti, is-self u l-kollateral			
No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 1 Field 1 to Field 18 Table 2 Field 1 to Field 99	<pre> &lt;SciesFincgRptgTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;LnData&gt; ... &lt;/LnData&gt; &lt;CollData&gt; ... &lt;/CollData&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SciesFincgRptgTxStatRpt&gt; </pre>

461. Barra minn hekk, id-*data* dwar il-marġni u l-użu mill-ġdid huma rrapportati fil-livell tal-istat ta' tmiem tad-*data* mill-kontropartijiet, mill-ERR jew mill-RSE. Dan ma jipprekludix lil kontroparti relatriċi, ERR jew RSE milli tirrapporta din l-informazzjoni f'diversi lottijiet.

462. Jenħtieġ li t-TR jipprovdi lill-awtoritajiet fir-rapport ta' attività auth.070.001.01 (marġni), ir-rapporti kollha dwar il-marġni tal-SFT li jkunu ġew ippreżentati f'jum partikolari u fir-rapport dwar l-istat auth.085.001.01 l-aktar stat riċenti tal-marġni kollha tal-SFT li ġew irrapportati għad-*data* tal-avveniment rilevanti jew f'każ li ma tkun giet irrapportata l-ebda informazzjoni għal data partikolari, l-añhar informazzjoni rrapportata.

**Tabella 117 – Rapport tal-SFT – data dwar il-marġni**

No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 3 Field 1 to Field 20	<pre> &lt;SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPty&gt; ... &lt;/CtrPty&gt; &lt;CollPrftfllId&gt;...&lt;/CollPrftfllId&gt; &lt;PstdMrgnOrColl&gt; ... &lt;/PstdMrgnOrColl&gt; &lt;RcvdMrgnOrColl&gt; ... &lt;/RcvdMrgnOrColl&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SciesFincgRptgMrgnDataTxStatRpt&gt; </pre>

463. Meta jipprovdu aċċess għad-*data* dwar l-użu mill-ġdid fir-rigward tal-NFC SME, it-TRs jenħtieġ li jipprovdu lill-awtoritajiet bl-informazzjoni kollha rrapportata bit-tipi ta' azzjoni "NEWT" u "REUU" għall-kontroparti relatriċi għad-*data* tal-avveniment partikolari. Jenħtieġ li t-TRs jużaw il-kampijiet "Entità responsabbli għar-rapportar" u "Entità li tippreżenta r-rapport" biex jiddeterminaw l-istanzi applikabbli. Meta għal kontroparti relatriċi partikolari jkun hemm aktar minn entità waħda responsabbli għar-rapportar, u dawn jużaw l-istess entità li tippreżenta r-rapport, jenħtieġ li t-TRs jipprovdu r-rapporti kollha dwar l-użu mill-ġdid tal-kollateral għal dik id-*data* tal-avveniment li jkunu ġew ippreżentati lill-kontroparti relatriċi.
464. Jenħtieġ li t-TR jipprovdi lill-awtoritajiet fir-rapport ta' attività auth.071.001.01, ir-rapporti kollha dwar l-użu mill-ġdid tal-kollateral tal-SFT li jkunu ġew ippreżentati f'jum partikolari u fir-rapport dwar l-istat auth.086.001.01 l-aktar stat riċenti tar-rapporti kollha dwar l-użu mill-ġdid tal-kollateral tal-SFT li ġew irrapportati għad-*data* tal-avveniment rilevanti jew f'każ li ma tkun giet irrapportata l-ebda informazzjoni għal *data* partikolari, l-aħħar informazzjoni rrapportata.

**Tabella 118 – Rapport tal-SFT – data dwar l-użu mill-ġdid**

No.	Field	Details to be reported	XML schema
1	Reportable field	Table 4 Field 1 to Field 18	<pre> &lt;SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt&gt; &lt;Stat&gt; ... &lt;CtrPtyData&gt; ... &lt;/CtrPtyData&gt; &lt;CollCmpnt&gt; ... &lt;/CollCmpnt&gt; ... &lt;FndgSrc&gt; ... &lt;/FndgSrc&gt; &lt;RcncltnFlg&gt; ... &lt;/RcncltnFlg&gt; &lt;CtrctMod&gt; ... &lt;/CtrctMod&gt; ... &lt;/Stat&gt; ... &lt;/SciesFincgRptgReusdCollDataTxStatRpt&gt; </pre>

465. Fir-rigward tad-dettalji rilevanti ta' rapporti tal-SFT rifjutati mit-TR, inkluż kwalunkwe rapport tal-SFT irrifjutat matul il-jum ta' xogħol ta' qabel u r-raġunijiet għar-rifjut tagħhom, kif speċifikat skont it-Tabella 2 tal-Anness I għall-RTS dwar il-verifika tad-*data*, jenhtieg li t-TRs jużaw l-istess mudell XML bħal fit-Tabella 113 – Feedback dwar ir-rifjut.

**Tabella 119 – Rapport dwar ir-rifjuti**

No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Number of files received		Numeric values	
2	No. of files accepted		Numeric values	
3	No. of files rejected		Numeric values	
4	File identification		Textual value	
5	Rejection reason		Error code	
6	Rejection description		Error description	
7	Number of SFT received		Numeric values	
8	No. of SFT accepted		Numeric values	
9	No. of SFT s rejected		Numeric values	
10	Identification of the SFT			
11	Reporting counterparty	Unique key of the SFT	Table 1 Field 3	

Tabella 119 – Rapport dwar ir-rifjuti				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
12	UTI		Table 2 Field 1	
13	Other counterparty		Table 1 Field 11	
14	Master agreement type		Table 2 Field 9	
15	Rejection reason		Error codes	
16	Rejection description		Error description	

466. Fir-rigward tal-istatus ta' rikonċiljazzjoni tal-SFTs irrapportati kollha li għalihom it-TR ikun wettaq il-proċess ta' rikonċiljazzjoni skont l-RTS dwar il-verifika tad-*data* (hliet dawk l-SFTs li skadew jew li għalihom ġew riċevuti rapporti tal-SFTs bit-tipi ta' azzjoni "Żball", "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija", jew "Komponent ta' pożizzjoni" aktar minn xahar qabel id-data li fiha jseħh il-proċess ta' rikonċiljazzjoni), jenħtiegħ li t-TR juża l-istess mudell XML bħal fit-Tabella 115 - Feedback dwar ir-Rikonċiljazzjoni.
467. L-XSD għe aġġornat biex jippermetti l-provvista ta' valuri ta' rikonċiljazzjoni għal diversi elementi tal-kollateral għaž-żewġ kontropartijiet, l-ERR, l-entità li tippreżenta r-rapport u l-awtoritajiet.
468. Ir-rizultati tar-rikonċiljazzjoni tal-kollateral jenħtiegħ li jiġu rrapportati darba biss għan-negożji kollha li jaqgħu taħt l-istess tip ta' ftehim prinċipali, u l-iskopertura netta tal-kollateralizzazzjoni hija VERU.

Tabella 120 – Rapport dwar l-istatus ta' rikonċiljazzjoni tal-SFT				
No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
1	Reporting counterparty	Unique key	Table 1 Field 3	
2	UTI		Table 2 Field 1	
3	Other counterparty		Table 1 Field 11	
4	Master agreement type		Table 2 Field 9	
5	Report status		Paired/Reconciled	
7	Modification status	Information if the transaction subject of reconciliation was modified	True/False	
8	No Reconciliation required	Indication that the transaction is not subject of reconciliation	True/False	
9	Matching status		True/False	
10	Loan reconciliation status		reconciled/not reconciled	
11	Reportable loan fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		
12	Collateral reconciliation status		reconciled/not reconciled	

**Tabella 120 – Rapport dwar l-istatus ta' rikonciljazzjoni tal-SFT**

No.	Field	Additional information	Details to be reported	XML schema
13	Reportable collateral fields subject of reconciliation	Only not reconciled fields are to be reported, both values subject of reconciliation shall be reported		

469. Ladarba jirċievu domanda, jenħtieġ li t-TRs jivvalidaw jekk id-domanda tkunx korretta u tistax tiġi pproċessata mis-sistemi tagħhom. F'każ ta' domandi dwar *data* mhux validi (eż. id-domanda mhix konformi), it-TR jibgħat messaġġ ta' feedback lill-awtorità li fih jiddikjara li d-domanda hija invalida, inkluża d-deskrizzjoni tat-tip ta' żball.

```

<FinInstrmRptgStsAdv>
  <MsgStsAdv>
    <MsgSts>
      <RptSts>RJCT</RptSts>
      <VldtnRule>
        <Id>EXE-003</Id>
        <Desc>Description of the rule</Desc>
      </VldtnRule>
      <RefDt>2017-11-15T10:35:55Z</RefDt>
    </MsgSts>
  </MsgStsAdv>
</FinInstrmRptgStsAdv>

```

470. Jenħtieġ li t-TRS jeżegwixxu domandi *ad hoc* dwar id-*data* malajr kemm jista' jkun wara s-sottomissjoni u l-validazzjoni tagħhom, anke f'jiem mhux ta' xogħol. Iż-żmien għall-għoti ta' tveġibiet għal mistoqsijiet *ad hoc* huwa speċifikat fl-Artikolu 5(4) RTS dwar l-aċċess għad-*data*:

- a. fejn jintalab aċċess għal dettalji ta' SFTs pendenti, jew ta' SFTs li jew ikunu mmaturaw jew li għalihom ikun hemm rapporti bit-tipi ta' azzjoni "Żball", "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija", jew "Komponent ta' pożizzjoni" kif imsemmi fil-Kamp 98 tat-Tabella 2 tal-Anness I għall-ITS dwar ir-rapportar, li ma jkunux saru aktar minn sena qabel id-*data* li fiha tkun giet ipprezentata t-talba: mhux aktar tard minn 12:00 tal-Ħin Universali Koordinat fl-ewwel jum tal-kalendarju wara l-jum li fih tiġi ipprezentata t-talba għall-aċċess.



- b. fejn jintalab aċċess għad-dettalji ta' SFT li jew ikunu mmaturaw jew li għalihom ikun hemm rapporti bit-tipi ta' azzjoni "Żball", "Terminazzjoni/Terminazzjoni bikrija", jew "Komponent ta' pożizzjoni" kif imsemmi fil-Kamp 98 tat-Tabella 2 tal-Anness I għall-ITS dwar ir-rapportar, li jkunu saru aktar minn sena qabel id-data li fiha tkun ġiet ippreżentata t-talba: mhux aktar tard minn tliet ijiem ta' xogħol mindu tiġi ppreżentata t-talba għall-aċċess.
  - c. fejn jintalab aċċess għad-dettalji ta' SFT li taqa' kemm taħt il-punt (a) kif ukoll il-punt (b): mhux aktar tard minn tliet ijiem ta' xogħol mindu tiġi ppreżentata t-talba għall-aċċess.
471. Jekk iż-żmien tal-preżentazzjoni tad-domanda dwar id-*data* jkun iqsar minn jum wieħed qabel l-ewwel data ta' eżekuzzjoni, l-ewwel eżekuzzjoni tkun tista' tiġi posposta sal-jum tal-eżekuzzjoni ta' wara skont il-parametri speċifikati fid-domanda.
472. Jekk l-eżekuzzjoni ta' domanda ma tirnax minhabba raġunijiet tekniċi, it-TRs għandhom jibagħtu messaġġ ta' żball lis-Sistema tal-ESMA. Jenħtieġ li l-messaġġ tal-iżball jiddeskrivi liema tip ta' żball seħħ.
473. Bħala tveġiba għal kull domanda dwar id-*data*, TR iħejji fajl ta' rispons li jkun fih *data* dwar it-tranzazzjonijiet kollha ta' finanzjament tat-titoli li jissodisfaw il-kriterji ta' tiftix iddefiniti mill-awtorità:
- a) Għal domanda tat-tip *ad hoc* jiġi ppreparat fajl ta' tveġiba ta' darba (fajl wieħed ta' tveġiba għal kull domanda);
  - b) Għal domanda rikorrenti, il-fajls ta' tveġiba jithejjew fuq bażi regolari skont il-frekwenza ddefinita mill-awtorità.
474. Jenħtieġ li t-TRs jippermettu lill-entitajiet inklużi fl-Artikolu 12(2) SFTR jistabbilixxu frekwenza għall-aċċess għad-*data* differenti minn dik ta' kuljum. Meta tiġi stabbilita d-durata massima tal-eżekuzzjoni ta' domanda rikorrenti, jenħtieġ li t-TRs iqisu l-ħtiġijiet tal-entitajiet elenkati fl-Artikolu 12(2) SFTR u jillimitaw ir-riskji għall-funzjonament tas-sistemi tagħhom.
475. L-Artikolu 5 tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data* ma jirreferix għall-iskedi ta' żmien li t-TRs jenħtieġ li jsegwu 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.
476. Jenħtieġ 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 Target2. Fejn f'ċirkostanzi eċċezzjonali din tkun taħbat f'jum ta' xogħol bħal dan, il-manutenzjoni skedata jenħtieġ li ssir barra mill-ħinijiet normali tax-xogħol, jiġifieri kmieni ħafna filgħodu jew tard ħafna billejl. Jenħtieġ li t-TRs jiżguraw li l-manutenzjoni skedata msemija hawn fuq ma titwettaqx b'mod li tiġi evitata d-disponibbiltà puntwali ta' informazzjoni dwar l-SFTs lill-awtoritajiet.
477. Jenħtieġ li t-TRs jużaw mezzi elettronici biex jinnotifikaw lill-awtoritajiet kollha bid-dati tal-bidu u tat-tmiem u bil-ħinijiet tal-manutenzjoni skedata tagħhom.

478. 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 jista' 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, jenħtieġ 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*.
479. Jenħtieġ li t-TRs iżommu rekord tan-notifiki rilevanti li jistgħu jsiru disponibbli għall-ESMA fuq talba. Ir-rekords relatati man-notifiki dwar manutenzjoni skedata jenħtieġ 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.
480. Fil-każ ta' verifika tat-talbiet skont l-Artikolu 5(5) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*, jenħtieġ li t-TRs jikkonfermaw li rċievew u li 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*.
481. Fil-każ ta' aċċess għad-*data* skont il-punt a) tal-Artikolu 5(4) tal-RTS dwar l-aċċess għad-*data*, jenħtieġ li t-TRs ifittxu li jlestu t-talba mal-ewwel opportunità u mhux aktar tard minn 12:00 tal-Ħin Universali Koordinat fl-ewwel jum tal-kalendarju wara l-jum li fih titlesta l-manutenzjoni skedata li jkollha impatt fuq is-servizzi tat-TRs relatati mal-aċċess tal-awtoritajiet għad-*data*. L-iskedi ta' żmien fil-punti b) u c) tal-Artikolu 5(4) jibqgħu mhux affettwati.
482. Fil-każ ta' manutenzjoni mhux skedata, jenħtieġ 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. Jenħtieġ li t-TRs jinnotifikaw lill-ESMA dwar il-manutenzjoni mhux skedata skont il-proċeduri tagħhom.
483. Il-fajls tal-output jitfejjew minn TRs fil-format XML tal-ISO 20022. Il-fajls tal-output jenħtieġ li jkun fihom subsett tad-*data* dwar l-SFTs li jkun limitat għall-mandat legali tal-awtorità, skont l-Artikoli 1 u 2 RTS dwar l-aċċess għad-*data*.
484. Il-fajls tal-output għandu jkun fihom subsett tad-*data* dwar it-tranzazzjonijiet skont il-kriterji ddefiniti fid-domanda għad-*data*. Meta n-numru ta' rekords fit-twegiba għal domanda jkun kbir, it-twegiba għandha tinqasam f'ħafna fajls.
485. Għal kull transazzjoni, il-fajl tal-output għandu jinkludi l-kampijiet kollha kif speċifikat fl-RTS u fl-ITS u rapportati lit-TRs mill-kontropartijiet. Il-kriterji dwar id-domanda għad-*data* jenħtieġ li jillimitaw biss in-numru tal-parametri tad-domanda (kampijiet li jistgħu jsiru domandi dwarhom) u, b'konsegwenza, in-numru ta' rekords inklużi fil-fajl tal-output, u mhux l-ambitu tal-informazzjoni pprovduta għal kull negozju (jiġifieri n-numru ta' kampijiet għal kull transazzjoni).
486. Jekk l-eżekuzzjoni ta' domanda ma tirritorna l-ebda tranzazzjoni, jenħtieġ li t-TR jibgħat messaġġ ta' feedback rilevanti.