



European Securities and
Markets Authority

Linji gwida

**Dwar il-kalkolu ta' pożizzjoni mir-Repożitorji tad-Data dwar it-
Tranzazzjonijiet skont l-EMIR**



Werrej

I. Kamp ta' applikazzjoni.....	3
II. Referenzi leġiżlattivi, abbrevjazzjonijiet u glossarju	4
III. Għan	6
IV. Obbligi ta' konformità u ta' rappurtar.....	8
V. Linji gwida dwar il-kalkolu ta' pożizzjoni mir-Repożitorji tad-Data dwar it-Tranzazzjonijiet skont I-EMIR.....	9

I. Kamp ta' applikazzjoni

Min?

1. Dawn il-linji gwida japplikaw għal repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet (TRs) irreġistrati jew rikonoxxuti mill-ESMA.

Xiex?

2. Il-linji gwida adottati jipprovdu informazzjoni biex tiġi żgurata l-armonizzazzjoni u l-konsistenza fir-rigward ta':
 - a. il-kalkoli mwettqa minn TRs skont l-Artikolu 80(4) tar-Regolament (UE) Nru 648/2012(EMIR)¹;
 - b. il-livell ta' aċċess għal pożizzjonijiet ipprovdut minn TRs lill-entitajiet inklużi fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR b'aċċess għal pożizzjonijiet f'konformità mal-Artikolu 2 tar-Regolament (UE) Nru 151/2013² (minn hawn' il quddiem, "is-CDR dwar l-aċċess għad-data"); u
 - c. l-aspetti operazzjonali għall-aċċess għad-data tal-pożizzjoni mill-entitajiet inklużi fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR.

Meta?

3. Dawn il-linji gwida japplikaw mit-3 ta' Diċembru 2018.

¹Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet, ĠU L201, 27.7.2012, p. 1-59

²Regolament ta' Delega tal-Kummissjoni (UE) Nru 151/2013 tad-19 ta' Diċembru 2012 li jissupplimenta r-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet fir-rigward ta' standards tekniċi regolatorji li jspecifikaw id-data li trid tiġi ppubblikata u li għandha tkun disponibbli minn repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet u standards operattivi biex tiġi aggregata, imqabbla u aċċessata d-data, ĠU L52, 23.2.2013, p.33-36

II. Referenzi legiżlattivi, abbrevjazzjonijiet u glossarju

4. Sakemm ma jiġix speċifikat mod ieħor, it-termini użati fl-EMIR għandhom l-istess tifsira f'dawn il-linji gwida. Barra minn hekk, japplikaw il-kunċetti u t-termini li ġejjin:

Referenzi legiżlattivi u abbrevjazzjonijiet

EMIR	Ir-Regolament dwar l-Infrastrutturi tas-Suq Ewropew – ir-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-4 ta' Lulju 2012 dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet (minn hawn 'il quddiem, ir-Regolament)
ISO	Organizzazzjoni Internazzjonali għall-Istandardizzazzjoni
TR	Repożitorju tad-Data dwar it-Tranzazzjonijiet skont it-tifsira tal-Artikolu 2(2) tal-EMIR li ġie rreġistrat jew rikonoxxut mill-ESMA f'konformità mal-Artikoli 55 u 77 tal-EMIR rispettivament
XML	Lingwaġġ tal-Immarkar Estensibbli

Glossarju ta' kunċetti u termini

5. "Pożizzjonijiet" tfisser ir-rappreżentazzjoni ta' esponimenti bejn par ta' kontropartijiet li jinkludu Settijiet ta' Pożizzjonijiet, Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali, Settijiet ta' Pożizzjonijiet ta' Munita u Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali ta' Munita.
6. "Derivati Pendenti" huma dawk id-derivati, inklużi derivati kklerjati minn CCP, li huma inklużi taħt l-Artikolu 5(4)(b) tas-CDR dwar l-aċċess għad-data, kif emendat mir-Regolament Delegat tal-Kummissjoni 2017/1800 3 (minn hawn 'il quddiem "is-CDR emendat dwar l-aċċess għad-data") irrappurtati għal TR u li ma mmaturawx jew li ma kinux is-suġġett ta' rapport bit-tipi ta' azzjoni "E", "C", "P" jew "Z" kif imsemmi fil-Kaxxa 93 fit-

³Regolament Delegat tal-Kummissjoni (UE) 2017/1800 tad-29 ta' Ġunju 2017 li jemenda r-Regolament (UE) Nru 151/2013 li jissupplimenta r-Regolament (UE) 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill ĠU L259 7.10.2017 p. 14-17

Tabella 2 tar-Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) Nru 2017/105 4 (minn hawn' il quddiem, "l-ITS emendat dwar ir-rappurtar").

7. "Varjabbli" huma dawk il-valuri jew meħuda direttament mill-oqsma tar-rappurtar tal-EMIR jew derivati minn dawk l-oqsma li ser jintużaw minn TRs biex jikkalkulaw il-pożizzjonijiet.
8. "Awtorità" tfisser waħda mill-entitajiet imsemmija fl-Artikolu 81(3) tal-EMIR.
9. "Metrika" huma varjabbli użati biex jikkwantifikaw il-kalkoli differenti. L-oqsma użati għad-definizzjoni tal-metriċi (u d-dimensjonijiet) isegwu n-nomenklatura skont l-ITS emendat dwar ir-rappurtar. Pereżempju, T1F17 tfisser il-qasam 17 tat-tabella 1.
10. "Dimensjonijiet" huma varjabbli relatati mad-derivattivi li jintużaw għal derivati ta' grupp flimkien f'pożizzjonijiet.
11. "Sett ta' Pożizzjoni" tfisser (sett ta') derivati pendenti li huma kkunsidrati ekonomikament relatati skont id-dimensjonijiet tagħhom għal par ta' kontropartijiet. Is-settijiet ta' pożizzjoni ser ikun fihom derivati li huma funġibbli b'mod reċiproku kif ukoll dawk li mhumiex funġibbli b'mod reċiproku iżda għandhom karatteristiċi ekonomiċi simili.
12. "Data ta' Referenza" tfisser id-data li jirreferi għaliha l-kalkolu.

⁴ Regolament ta' Implimentazzjoni tal-Kummissjoni (UE) 2017/105 tad-19 ta' Ottubru 2016 li jemenda r-Regolament ta' Implimentazzjoni (UE) Nru 1247/2012 li jistipula standards tekniċi ta' implimentazzjoni rigward il-format u l-frekwenza tar-rapporti tan-negozju lir-repożitorji tan-negozju skont ir-Regolament (UE) Nru 648/2012 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet L17 ĠU 21.1.2017 p.17-41

III. Għan

Dispożizzjonijiet Legali

13. L-Artikolu 81(1) tal-EMIR jipprevedi li t-TR għandu, regolarment, u b'mod faċilment aċċessibbli, jippubblika pożizzjonijiet aggregati skont il-klassi tad-derivat fuq il-kuntratti rrapportati lilu.
14. Barra minn hekk, skont l-Artikolu 16(1) tar-Regolament (UE) Nru 1095/2010⁵, l-oġġettivi ta' dawn il-linji gwida huma li jiġu stabbiliti Prattiki superviżorji konsistenti, effiċjenti u effikaċi fi f'dan is-Sistema Ewropea ta' Superviżjoni Finanzjarja u li tiġi żgurata l-applikazzjoni komuni, uniformi u konsistenti tad-dispożizzjonijiet tal-EMIR li ġejjin:
 - a. L-Artikolu 80(4) tal-EMIR jipprevedi li t-TRs għandhom jikkalkulaw il-pożizzjonijiet skont il-klassi tad-derivati u skont l-entità ta' rappurtar abbażi tad-dettalji tal-kuntratti tad-derivati rrapportati skont l-Artikolu 9 tal-EMIR; u,
 - b. L-Artikolu 81(3) tal-EMIR li jipprevedi li TR għandu jagħmel l-informazzjoni meħtieġa disponibbli għall-awtoritajiet sabiex dawn ikunu jistgħu jwettqu r-responsabbiltajiet u l-mandati rispettivi tagħhom.

Għan

15. L-għan ta' dawn il-linji gwida huwa kif ġej:
 - a. Jiżguraw li l-awtoritajiet rilevanti jiġu pprovduti b'pożizzjonijiet konsistenti u armonizzati fir-rigward tad-derivati; u
 - b. Jiżguraw li d-data disponibbli għall-awtoritajiet fil-forma ta' aggregazzjonijiet imwettqa minn TRs tkun ta' standard għoli.
 - c. Dawn il-linji gwida jagħtu wkoll ingranagġ fuq ir-rekwiżit skont l-Artikolu 9 tal-EMIR, *"Kontropartijiet u CCPs għandhom jiżguraw li d-dettalji tad-derivati tagħhom jiġu rrapportati mingħajr duplikazzjoni"*, u fuq il-fatt li r-rappurtar ta' pożizzjonijiet ikklerjati

⁵ Regolament (UE) Nru 1095/2010 tal-Parlament Ewropew u tal-Kunsill tal-24 ta' Novembru 2010 li jstabbilixxi l-Awtorità Superviżorja Ewropea (Awtorità Ewropea tat-Titoli u s-Swieq) u li jemenda d-Deċiżjoni Nru 716/2009/KE u jhassar id-Deċiżjoni tal-Kummissjoni 2009/77/KE ĠU L 331, 15.12.2010, p. 84–119.

tas-CCP minn kontropartijiet isegwi Q & A TR 17⁶ u li ma hemmx għadd doppju bejn il-kummerċ u r-rapporti tal-pożizzjoni.

⁶ Mistoqsijiet u Tweġibiet - Implimentazzjoni tar-Regolament (UE) Nru 648/2012 dwar derivati OTC, kontropartijiet ċentrali u repożitorji tad-data dwar it-tranzazzjonijiet (EMIR) u aġġornati fuq bażi regolari

IV. Obbligi ta' konformità u ta' rappurtar

Status tal-linji gwida

16. F'konformità mal-Artikolu 16(3) tar-Regolament ESMA, il-partecipanti fis-swieq finanzjarji għandhom jagħmlu kull sforz possibbli biex jikkonformaw ma' dawn il-linji gwida.
17. L-ESMA ser tivvaluta l-applikazzjoni ta' dawn il-linji gwida permezz ta' TRs permezz tas-supervizjoni diretta kontinwa tagħha.

V. Linji gwida dwar il-kalkolu ta' pożizzjoni mir-Repożitorji tad-Data dwar it-Tranzazzjonijiet skont I-EMIR

1. It-TRs għandhom jikkalkulaw id-data ta' pożizzjoni u jagħmluha disponibbli f'erba' settijiet ta' data separati – Sett ta' Pożizzjoni, Sett ta' Pożizzjoni Kollaterali, Sett ta' Pożizzjoni ta' Munita u Sett ta' Pożizzjoni Kollaterali ta' Munita. Dawn is-settijiet ta' data għandhom ikunu identifikabbli b'mod uniku u ttikkettati bid-data ta' referenza rilevanti.
2. Sakemm ma jiġix speċifikat mod ieħor, il-linji gwida kollha japplikaw għal kull kalkolu. Dan jeskludi l-linji gwida li ġejjin li għandhom jiġu applikati biss għall-kalkoli li ġejjin:
 - a. Il-linja Gwida 19, il-Linja Gwida 24, il-Linja Gwida 25, il-Linja Gwida 26, il-Linja Gwida 31 u l-Linja Gwida 32 huma applikabbli għal Settijiet ta' Pożizzjoni;
 - b. Il-linja Gwida 20, il-Linja Gwida 24, il-Linja Gwida 25, il-Linja Gwida 26, il-Linja Gwida 31 u l-Linja Gwida 32 huma applikabbli għas-Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita;
 - c. Il-linja Gwida 21, il-Linja Gwida 22, il-Linja Gwida 23 u l-Linja Gwida 30 huma rilevanti għas-Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali;
 - d. Il-linja Gwida 21, il-Linja Gwida 22, il-Linja Gwida 23, il-Linja Gwida 30, il-Linja Gwida 31 u l-Linja Gwida 33 huma applikabbli għal Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali ta' Munita;
 - e. Il-linja Gwida 27 hija applikabbli biss għal Settijiet ta' Pożizzjoni u Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita fejn it-taqsim tal-klassi ta' Assi (T2F2) hija rrapportata bħala "IR" u t-taqsim tat-tip ta' Kuntratt (T2F1) hija rrapportata bħala "SW";
 - f. Il-linja Gwida 28 hija applikabbli biss għal Settijiet ta' Pożizzjoni u Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita fejn it-taqsim tal-klassi ta' Assi (T2F2) hija rrapportata bħala "CR";
 - g. Il-linja Gwida 29 hija applikabbli biss għal Settijiet ta' Pożizzjoni u Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita fejn it-taqsim tal-klassi ta' Assi (T2F2) hija rrapportata bħala "CO".
3. Meta jiġu kkalkulati l-pożizzjonijiet huwa essenzjali li l-informazzjoni użata tkun aġġornata u rilevanti. L-informazzjoni li għandha tintuża għall-kalkoli hija bbażata biss fuq l-informazzjoni disponibbli fid-data tal-Istat tal-Kummerċ dwar derivati pendenti.
4. It-TRs għandhom jikkalkulaw il-pożizzjonijiet filwaqt li jqisu l-aħħar stat kummerċjali tad-derivati pendenti rrapportati lilhom fil-mument tal-kalkolu tal-pożizzjoni.

5. It-TRs għandhom jikkalkulaw il-pożizzjonijiet b'mod konsistenti irrispettivament minn jekk id-derivat irrappurtat huwiex b'naħa waħda jew b'żewġ naħat u b'mod konsistenti irrispettivament mill-istatus ta' rikonċiljazzjoni tar-rapport.
6. It-TRs għandhom jiddeterminaw derivati pendenti, inklużi (i) il-kontropartijiet għal negozju u (ii) id-data tal-istat ta' kummerċ sabiex jiġi kkalkulat is-sett ta' derivati pendenti li jappartjenu għal pożizzjoni.
7. It-TRs għandhom jinkludu r-rapporti dwar derivati rilevanti kollha miżmuma minn TR pertinenti għal pożizzjoni ta' ID ta' kontroparti li Tirrapporta partikolari (T1F2) fil-kalkolu tal-pożizzjoni rilevanti. It-TRs għandhom jinkludu derivati irrispettivament minn jekk humiex jew ma jkunux rikonċiljati, akkoppjati jew imqabbla.
8. It-TRs għandhom jikkalkulaw il-pożizzjonijiet fuq bażi ta' "l-aħjar informazzjoni disponibbli". It-TRS għandhom jinkludu l-informazzjoni kollha, kif disponibbli fid-data tal-kalkolu tal-pożizzjoni, li tikkonforma mar-regoli ta' validazzjoni komuni fil-kalkolu tal-pożizzjoni, irrispettivament mill-istat ta' rikonċiljazzjoni.
9. It-TRs għandhom jiżguraw li l-kalkoli jkunu relatati mad-data l-aktar reċenti ta' data tal-istat ta' kummerċ tal-jum sfiħ. Il-kalkoli għandhom jiġu aġġornati f'kull jum ta' negozju. It-TRs għandhom ukoll jagħmlu l-pożizzjoni disponibbli għall-awtoritajiet fil-jum tal-kalkolu skont il-passi li ġejjin:

	Avveniment	Jum/ħin
1	Tmien tal-jum ta' negozjar T	Jum T
2	Ikseb rati ta' referenza FX xierqa fil-jum T għall-finijiet ta' konverżjoni għal derivati fejn T1F17 (Valur tal-kuntratt) għandu jiġi kkonvertit, li għandu jiġi applikat meta l-kalkolu jsir f'jum T+2. (Il-Linja Gwida 16)	Jum T 16:00 UTC (17:00 CET)
3	Entitajiet ta' rappurtar biex jipprovdu rapporti lil TRs dwar derivati nnegozjati fil-jum T	Minn Jum T - Jum T+1 23:59 UTC
4	Skadenza għas-sottomissjoni ta' rapporti lil TRs dwar derivati nnegozjati fil-jum T	Jum T+1 23:59 UTC
5	Il-kalkolu ta' TR ta' pożizzjonijiet ibbażati fuq l-istat kummerċjali l-aktar reċenti tad-derivati pendenti fi tmiem il-jum T+1	Jum T+2 00:00 UTC - 12:00 UTC (13:00 CET)
6	Ir-rapporti tal-pożizzjoni abbażi tal-jum ta' negozjar T jitqiegħdu għad-dispożizzjoni mill-awtoritajiet rilevanti mit-TR.	Jum T +2 12:00 UTC (13:00 CET) 'il quddiem.

10. Meta t-TRs jipprovdu awtorità b'aċċess għal data żbaljata, u t-TR ikun ikkawża l-iżball huwa stess, id-data għandha tiġi aġġornata mit-TR sabiex tiġi kkoreġuta hekk kif ikun possibbli u l-kalkoli żbaljati għas-sentejn ta' qabel, sa mill-aħħar jum tax-xogħol ta' kull ġimgħa, għandhom jiġu rrapportati mill-ġdid b'mod korrett. Meta żball minn kontroparti li tirrapporta, aktar milli t-TR, wassal għal kalkolu żbaljat minn TR, l-awtoritajiet kollha għandhom jiġu nnotifikati, u jingħataw l-opportunità li jitolbu verżjoni emendata ta' kull kalkolu li ma kienx korrett mit-TR rilevanti.
11. It-TRS għandhom iżommu rekord tal-kalkoli kollha tal-pożizzjoni li huma jkunu kkalkolaw għal mill-inqas sentejn.
12. It-TRs li jirċievu data f'konformità mal-linji gwida dwar il-portabbiltà għandhom iżommu l-pożizzjonijiet ikkalkulati qabel ittrasferiti mit-TR l-antik għal mill-inqas sentejn u jsegwu l-Linja Gwida 11 b'mod prospettiv.
13. It-TRs għandhom jeskludu derivati li jkollhom data nieqsa għal waħda mill-metriċi jew id-dimensjonijiet meħtieġa mill-kalkoli kollha rilevanti. It-TRs għandhom jagħmlu dan anki f'każijiet fejn id-derivat irrappurtat huwa konformi mar-regoli ta' validazzjoni.
14. TR għandu jkollu fis-seħħ proċedura robusta biex jidentifika valuri anormali, jiġifieri outliers, relatati mad-derivati li jirċievi mingħand il-kontropartijiet. Għal pożizzjoni partikolari, TR għandu jikkalkula pożizzjonijiet skont il-metriċi li jeskludu rapporti b'outliers, kif ukoll metriċi li jinkludu r-rapporti kollha li jissodisfaw id-dimensjonijiet għal kull kalkolu.
15. It-TRs għandhom jipprovdu aċċess għal pożizzjonijiet lill-awtoritajiet rilevanti bl-użu ta' mudell ISO 20022 XML u skont l-istandards operazzjonali definiti fl-Artikoli 4 u 5 tas-CDR dwar l-aċċess għad-data.
16. Meta l-munita nozzjonali jew il-valur tan-naħa tax-xerrej jew tan-naħa tal-bejjiegħ ma jaqblux mal-munita tal-kollateral, it-TRs għandhom jikkonvertu l-metriċi kollha li huma vvalutati f'munita għal ewros. Dan għandu jsir permezz tat-TR bl-użu tar-rata tal-kambju barranija rilevanti ppubblikata fuq is-sit web tal-BĊE fid-data ta' referenza. Jekk ir-rata meħtieġa ma tiġix ippubblikata allura t-TRs għandhom jużaw rata ta' referenza alternattiva xierqa.
17. Fuq talba mill-ESMA, TR għandu jkollu disponibbli f'kull hin l-algoritmi ta' kalkolu li jużaw kif ukoll il-proċedura(i) li jsegwu biex jipproduċu kull wieħed mill-erba' settijiet ta' data relatati mal-kalkoli tal-pożizzjoni deskritti f'dawn il-Linji Gwida.
18. Lċ-ċifri inklużi fil-kalkoli m'għandhomx jiġu mqarrba iżda l-pożizzjoni kkalkulata għandha titqarreb għal ċifra xierqa.
19. It-TRs għandhom jikkalkulaw u jikkwantifikaw il-pożizzjonijiet fuq bażi gross billi jaggregaw skont il-metrika kwantitattiva li ġejja Meta l-pożizzjoni ma tinkludix outliers hija msemmija bħala "nadifa", meta tinkludi outliers tissejjaħ "totali".

- a. In-numru totali ta' negozji użati għall-kalkolu tal-pożizzjoni tan-Naħa tax-Xerrej: Dan jirreferi għan-numru ta' negozji li jinsabu fis-sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti tar-Rappurtar (T1F2) irrappurtat "B" fil-qasam tal-Naħa tal-Kontroparti (T1F14);
- b. Għadd totali ta' negozji użati għall-kalkolu tal-pożizzjoni tan-Naħa tal-Bejjiegħ: Dan jirreferi għan-numru ta' negozji li jinsabu fis-sett ta' pożizzjoni stabbilit li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14);
- c. Nozzjonali Totali Negattiv tan-Naħa tax-Xerrej: Aggregazzjonijiet tal-valuri Negattivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti tar-Rappurtar (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- d. Nozzjonali Totali Pożittiv tan-Naħa tax-Xerrej: Aggregazzjonijiet tal-valuri Pożittivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- e. Nozzjonali Totali Negattiv tan-Naħa tal-Bejjiegħ: Aggregazzjonijiet tal-valuri Negattivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- f. Nozzjonali Totali Pożittiv tan-Naħa tal-Bejjiegħ: Aggregazzjonijiet tal-valuri Pożittivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- g. Meta l-Klassi tal-Assi (T2F2) tkun "Kreditu", allura l-metrika tal-ammont nozzjonali (il-Linja Gwida 19(c), (d), (e) jew (f)) għandha tiġi mmultiplikata bil-Fattur tal-Indiċi (T2F89);
- h. Valur Totali Negattiv tan-Naħa tax-Xerrej: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Negattivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur negattiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18);

- i. Valur Totali Pożittiv tan-Naħa tax-Xerrej: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Pożittivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur pożittiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18);
- j. Valur Totali Negattiv tan-Naħa tal-Bejjiegħ: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Negattivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur negattiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18);
- k. Valur Totali Pożittiv tan-Naħa tal-Bejjiegħ: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Pożittivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur pożittiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18).
- l. Numru nadif ta' negozji użati għall-kalkolu tal-pożizzjoni tan-Naħa tax-Xerrej bl-outliers kollha li tneħħew: Dan jirreferi għan-numru ta' negozji li jinsabu fis-sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti tar-Rappurtar (T1F2) irrappurtat "B" fil-qasam tal-Naħa tal-Kontroparti (T1F14);
- m. Numru nadif ta' negozji użati għall-kalkolu tal-pożizzjoni tan-Naħa tal-Bejjiegħ bl-outliers kollha li tneħħew: Dan jirreferi għan-numru ta' negozji li jinsabu fis-sett ta' pożizzjoni stabbilit li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14);
- n. Nozzjonali Negattiv Nadif tan-Naħa tax-Xerrej: Aggregazzjonijiet tal-valuri Negattivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha (ħlief dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- o. Nozzjonali Pożittiv Nadif tan-Naħa tax-Xerrej: Aggregazzjonijiet tal-valuri Pożittivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha (ħlief dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- p. Nozzjonali Negattiv Nadif tan-Naħa tal-Bejjiegħ: Aggregazzjonijiet tal-valuri Negattivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha (ħlief dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-

- Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
- q. Nozzjonali Pożittiv Nadif tan-Naħa tal-Bejjiegħ: Aggregazzjonijiet tal-valuri Pożittivi kollha fil-qasam Nozzjonali (T2F20) għad-derivati kollha (flief dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). L-ammont nozzjonali għandu jiġi espress f'termini tal-ammont u fil-Munita Nozzjonali 1 irrappurtata (T2F9);
 - r. Meta l-Klassi tal-Assi (T2F2) tkun "Kreditu", allura l-metrika tal-ammont nozzjonali (il-Linja Gwida 19(n), (o), (p) jew (q)) għandha tiġi mmultiplikata bil-Fattur tal-Indiċi (T2F89);
 - s. Valur Negattiv Nadif tan-Naħa tax-Xerrej: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Negattivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha (minbarra dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur negattiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18);
 - t. Valur Pożittiv Nadif tan-Naħa tax-Xerrej: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Pożittivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha (minbarra dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "B" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur pożittiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18);
 - u. Valur Negattiv Nadif tan-Naħa tal-Bejjiegħ: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Negattivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha (minbarra dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur negattiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18); u
 - v. Valur Pożittiv Nadif tan-Naħa tal-Bejjiegħ: L-aggregazzjonijiet tal-Valuri Pożittivi kollha tad-derivat (T1F17) għad-derivati kollha (minbarra dawk meqjusa li huma outliers mit-TR) li jappartjenu għal sett ta' pożizzjoni li għalih I-ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2) tkun irrappurtat "S" fil-qasam tan-Naħa tal-Kontroparti (T1F14). Il-valur pożittiv għandu jiġi espress f'termini ta' ammont u fil-Munita rrappurtata tal-valur (T1F18).
20. It-TRs għandhom jużaw il-metriċi elenkati fil-Linja Gwida 19 għal pożizzjonijiet ta' munita aggregata fuq bażi grossa li għandha tkun disponibbli għall-bank ċentrali li joħroġ dik il-munita.

21. Il-metriċi li ġejjin għandhom jintużaw biex jikkwantifikaw is-Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali u s-Settijiet ta' Pożizzjoni Kollaterali ta' Munita kollha. Meta l-outliers jitneħħew mill-pożizzjoni, il-kalkolu jissejjaħ "nadif", jekk jiġu inklużi outliers, il-pożizzjoni tissejjaħ "totali":
- a. Għadd Totali ta' rapporti użati għall-kalkolu tas-Sett.
 - b. Marġni Inizjali Totali depożitat (T1F24).
 - c. Marġni Totali ta' Varjazzjoni depożitat (T1F26).
 - d. Marġni Inizjali Totali riċevut (T1F28).
 - e. Marġni Totali ta' Varjazzjoni riċevut (T1F30).
 - f. Total ta' Kollateral f'Eċċess depożitat (T1F32).
 - g. Total ta' Kollateral f'Eċċess riċevut (T1F34).
 - h. Għadd Nadif ta' rapporti użati għall-kalkolu tas-Sett, outliers imneħħija.
 - i. Marġni Inizjali Nadif depożitat (T1F24), outliers imneħħija.
 - j. Marġni ta' Varjazzjoni Nadif depożitat (T1F26), outliers imneħħija.
 - k. Marġni Inizjali Nadif riċevut (T1F28), outliers imneħħija.
 - l. Marġni ta' Varjazzjoni Nadif riċevut (T1F30), outliers imneħħija.
 - m. Kollateral f'Eċċess Nadif depożitat (T1F32), outliers imneħħija.
 - n. Kollateral f'Eċċess Nadif riċevut (T1F34), outliers imneħħija.
22. Meta l-kollateralizzazzjoni titwettaq fuq bażi ta' portafoll u d-derivati jikkondividu kodiċi tal-portafoll tal-kollateral (T1F23), it-TRs għandhom jaggregaw kollateral billi jieħdu l-medjan tal-valuri kollaterali kollha elenkati fil-Linja Gwida 21 fir-rapporti kollha li jikkondividu l-kodiċi, bħala l-valur ta' dak il-portafoll tal-kollateral għall-finijiet tas-Sett ta' Pożizzjoni Kollaterali.
23. Meta l-kollateralizzazzjoni ma titwettaqx fuq bażi ta' portafoll, il-varjabbli li jirrappreżentaw il-valur tal-kollateral japplikaw biss għal derivat individwali u, għalhekk fejn possibbli, it-TRs għandhom jipprovdu aggregazzjoni ta' dawk il-pożizzjonijiet tal-kollateral abbażi tal-Metrika elenkata fil-Linja Gwida 21.
24. Id-derivati kollha rrappurtati lit-TRs għandhom jiġu aggregati b'derivati b'entrati identiċi fl-oqsma li ġejjin li jirrappreżentaw id-dimensjonijiet tad-derivati miġbura flimkien f'settijiet ta' pożizzjoni biex jispeċifikaw il-kontropartijiet għad-derivati:
- a. ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2)

- b. ID tal-Kontroparti l-oħra (T1F4);
- c. Munita tal-valur (T1F18);
- d. Kollateralizzazzjoni (T1F21);
- e. Kodiċi tal-Portafoll tal-Kollateral (T1F23) jekk applikabbli;
- f. Tip ta' kuntratt (T2F1);
- g. Klassi tal-assi (T2F2);
- h. Tip ta' identifikazzjoni sottostanti (T2F7);
- i. Identifikazzjoni sottostanti (T2F8);
- j. Munita Nozzjonali 1 (T2F9);
- k. Munita Nozzjonali 2 (T2F10) jekk applikabbli;
- l. Munita Konsenjabbli (T2F11);
- m. Munita tal-Konsenja 2 (T2F61) jekk applikabbli;
- n. Tip ta' Ftehim Prinċipali (T2F30);
- o. Verżjoni tal-Ftehim Prinċipali (T2F31);
- p. Ikklerjat (T2F35);
- q. Intragrupp (T2F38)
- r. Bażi tar-Rata tal-Kambju (T2F64);
- s. Tip ta' għażla (T2F78), meta applikabbli.

25. It-TRs għandhom jużaw l-unitajiet li ġejjin għal derivati aggregati b'valuri simili għal "Żmien għall-Maturità". Iż-żmien għall-Maturità għandu jiġi kkalkulat bħala d-differenza bejn id-Data tal-Maturità ta' derivat u d-data ta' referenza, ibbażata fuq kalendarju Gregorjan.

Differenza bejn id-Data tal-Maturità u d-data ta' referenza	Valur ta' Żmien għall-
Xahar jew anqas	"T01_00M_01M"
Aktar minn xahar iżda mhux aktar minn tliet xhur (inklużivi)	"T02_01M_03M"
Aktar minn tliet xhur iżda inqas minn sitt xhur (inklużivi)	"T03_03M_06M"

Aktar minn sitt xhur iżda inqas minn disa' xhur (inklużivi)	"T04_06M_09M"
Aktar minn disa' xhur iżda inqas minn 12-il xahar (inklużivi)	"T05_09M_12Y"
Aktar minn tnax-il xahar iżda inqas minn sentejn (inklużivi)	"T06_01Y_02Y."
Aktar minn 24 xahar iżda inqas minn 3 snin (inklużivi)	"T07_02Y_03Y"
Aktar minn 36 xahar iżda inqas minn 4 snin (inklużivi)	"T08_03Y_04Y"
Aktar minn 48 xahar iżda inqas minn 5 snin (inklużivi)	"T09_04Y_05Y"
Aktar minn 5 snin iżda inqas minn 10 snin (inklużivi)	"T10_05Y_10Y"
Aktar minn 10 snin iżda inqas minn 15-il sena (inklużivi)	"T11_10Y_15Y"
Aktar minn 15-il sena iżda inqas minn 20 sena (inklużivi)	"T12_15Y_20Y"
Aktar minn 20 sena iżda inqas minn 30 sena (inklużivi)	"T13_20Y_30Y"
Aktar minn 30 sena iżda inqas minn 50 sena (inklużivi)	"T14_30Y_50Y"
Aktar minn 50 sena	"T15_50Y_XX_Y"
Id-data ta' maturità hija vojta (kuntratt indefinit)	"T16_BL"
Id-data tal-maturità mhijjex applikabbli (NA)	"T17_NA"

26. Fil-każ li derivat ikollu data tal-maturità li ma tkunx teżisti fix-xahar tad-data ta' referenza (jiġifieri 29, 30, 31 xahar dipendenti), id-deċiżjoni għal liema medda ta' maturità dak id-derivat għandu jiġi inkluż fiha għandha ssir billi dak id-derivattiv jiġi indirizzat bl-istess mod bħallikieku l-kalkolu kien qed isir fil-jum ta' maturità għax-xahar tad-data ta' referenza. Pereżempju, jekk kalkolu tad-derivat ikollu data ta' referenza tal-31 ta' Jannar u d-derivat jimmatūra fit-28 ta' Frar, dak id-derivat għandu jiġi inkluż fil-medda ta' maturità "Xahar jew inqas". Jekk id-data ta' referenza tkun il-31 ta' Jannar u d-data ta' maturità tkun l-1 ta' Marzu, dak id-derivat għandu jiġi inkluż fil-medda ta' maturità "Aktar minn xahar iżda mhux aktar minn tliet xhur". Jekk id-data ta' referenza tal-kalkolu tkun fit-30 ta' April, u d-derivat jimmatūra fil-31 ta' Mejju, dak id-derivat għandu jiġi inkluż fil-medda ta' maturità "Xahar jew inqas".

27. Id-derivati tal-IRS għandhom ukoll jingabru flimkien skont it-tip tagħhom. B'referenza għal jekk Segment 1 u Segment 2 humiex fissi jew varjabbli, it-tabella ta' hawn taħt tispjega kif għandu jiġi identifikat "it-tip ta' IRS" u kif id-derivati tal-IRS għandhom jingabru flimkien:

Rata fissa tas-segment 1	Rata fissa tas-segment 2	Rata varjabbli tas-segment 1	Rata varjabbli tas-segment 2	Valur tal-varjabbli Tip tal-IRS ⁷
P	B	B	P	FISS-VARJABBLI
B	P	P	B	FISS-VARJABBLI
P	P	B	B	FISS-FISS
B	B	P	P	BAŽI

P=Mimli, B= Vojt

28. Għad-derivati ta' kreditu, it-TRs għandhom jużaw id-dimensjonijiet li ġejjin biex jiġbru flimkien derivati għas-Settijiet ta' Pożizzjoni u s-Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita flimkien ma' dawk id-dimensjonijiet imsemmija mil-Linja Gwida 24 sal-Linja Gwida 26:

- a. Superjorità (T2F83), meta l-entità ta' referenza timtela fil-qasam "Entità ta' referenza";
- b. Segment (T2F90), meta l-indiċi jimtela fil-qasam "Identifikazzjoni sottostanti" (T2F8).

29. Għal derivati ta' komodità, it-TR għandu jaggrega metriċi għal klassijiet ta' derivati ta' komodità skont id-dimensjonijiet imsemmija fil-Linja Gwida 24 sal-Linja Gwida 26 ta' dan id-dokument skont kull wieħed mid-dettalji li ġejjin irrappurtati f'T2F65 u T2F66 tal-ITS emendata dwar ir-rappurtar:

- a. metalli – qasam tal-"baži tal-komodità" irrappurtat bħala "ME".
- b. prodotti taż-żejt – "dettalji tal-komodità" irrappurtati b'"OI"
- c. faħam – "dettalji tal-komodità" irrappurtati b'"CO"
- d. gass – "dettalji tal-komodità" irrappurtati b'"NG"
- e. potenza – "dettalji tal-komodità" irrappurtati b'"EL" jew "IE"

⁷ Fil-każ li r-rata Fissa tas-segment 1 hija mimlija bil-valur 1.00 u r-rata Varjabbli tas-segment 1 hija mimlija bil-valur "EUR", il-varjabbli Tip tal-IRS ser jimtela bil-valur "FIX_EUR". F'każ li s-segmenti fissi ma jimtlewx iżda f'rata Varjabbli tas-segment 1 jiġi pprovdut il-valur "LIBO" u fir-rata Varjabbli tas-segment 2 jiġi pprovdut il-valur "EUR", il-varjabbli Tip tal-IRS ser jimtela bil-valur "EUR_LIBO"

- f. prodotti agricoli – “baži tal-komodità” irrappurtat b’“AG”
 - g. komoditajiet oħra inklużi l-merkanzija u C10 – “baži tal-komodità” irrappurtat b’“FR” jew “IN” jew “EX” jew “OT” jew “dettalji tal-komodità” irrappurtati b’“WE”
 - h. derivati fuq kwoti tal-emissjonijiet – “dettalji tal-komodità” irrappurtati b’“EM”
 - i. mhux speċifikat – meta d-derivat ikun komodità taħt Klassi tal-Assi (T2F2) iżda ma jsegwix l-estrazzjonijiet preċedenti
 - j. vojt, meta d-derivat ma jkunx fi ħdan il-komodità Klassi tal-Assi (T2F2)
30. It-TRs għandhom jużaw id-dimensjonijiet li ġejjin biex jiġbru flimkien derivati billi jużaw l-istess kollateral. Meta kull waħda mid-dimensjonijiet ta’ hawn taħt jaqblu għal żewġ rapporti jew aktar ta’ kollateral b’Azzjoni tat-Tip “V”, dawk għandhom jingabru flimkien bħala Sett ta’ Pożizzjoni Kollaterali:
- a. ID tal-Kontroparti li Tirrapporta (T1F2)
 - b. ID tal-kontroparti l-oħra (T1F4)
 - c. Kollateralizzazzjoni (T1F21), u
 - d. Portafoll tal-Kollateral (T1F22)
 - e. Munita tal-marġni inizjali depożitat (T1F25)
 - f. Munita tal-marġni tal-varjazzjoni depożitat (T1F27)
 - g. Munita tal-marġni inizjali riċevut (T1F29)
 - h. Munita tal-marġni ta’ varjazzjoni riċevut (T1F31)
 - i. Munita tal-kollateral f’ecċess depożitat (T1F33)
 - j. Munita tal-kollateral f’ecċess riċevut (T1F35)
31. It-TRs għandhom jiddeterminaw is-Settijiet ta’ Pożizzjoni ta’ Munita rilevanti għal awtoritajiet fejn il-kontropartijiet ikunu rrapportaw il-munita tal-ħruġ ta’ dik l-awtorità għal waħda mid-dimensjonijiet ta’ hawn taħt.
- a. Munita Nozzjonali 1 (T2F9);
 - b. Munita Nozzjonali 2 (T2F10), jew
 - c. Munita Konsenjabbli (T2F11),
 - d. Munita tal-konsenja 2 (T2F61), meta applikabbli.

32. It-TRs għandhom jipprovdu Sett ta' Pożizzjoni ta' Munita lill-awtoritajiet iddeterminati skont il-Linja Gwida 31 u abbażi tad-dimensjonijiet kollha inklużi mil-Linja Gwida 24 sal-Linja Gwida 26. Il-linja Gwida 27, il-Linja Gwida 28 u l-Linja Gwida 29 għandhom jiġu applikati wkoll għas-Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita, meta jkun xieraq.
33. It-TRs għandhom jaggregaw il-kollateral li jappartjeni għas-Settijiet ta' Pożizzjoni ta' Munita stabbiliti skont il-Linja Gwida 31 u permezz tad-dimensjonijiet imsemmija fil-Linja Gwida 30.