**NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI TNHH NGOẠI THƯƠNG CÔNG NGHỆ SỐ**

**TÀI LIỆU ĐẶC TẢ YÊU CẦU NGHIỆP VỤ**

**(Business Requirements Document)**

**< ĐO LƯỜNG BÁO CÁO RỦI RO THỊ TRƯỜNG VÀ CÔNG TÁC OMC TRONG GIAO DỊCH KINH DOANH VỐN>**

**Mã hiệu dự án:**

**Mã hiệu tài liệu: BRD – v**

<Hồ Chí Minh, 07/2025>

**Bản ghi nhận thay đổi tài liệu**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Ngày thay đổi** | **Nội dung thay đổi** | **Mô tả thay đổi** | **Lý do thay đổi** | **Phiên bản mới** |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

1. **Tổng quan**
   1. **Mục đích**
      1. **Đối với đo lường các chỉ số rủi ro thị trường, rủi ro tập trung tự doanh**

* Bổ sung tính năng trích xuất dữ liệu danh mục GTCG hiện tại
* Tự động hóa việc định giá danh mục GTCG trên SKD
* Tự động hóa đo lường chỉ số Rủi ro thị trường, Rủi ro tập trung tự doanh
  + 1. **Đối với công tác OMC đối với giao dịch kinh doanh vốn**
* Tự động hóa việc trích xuất dữ liệu giao dịch trên thị trường 2 của Ban KDV bao gồm giao dịch mua/bán GTCG, giao dịch Repo/Reverse Repo, Giao dịch MM,…
* Tự động hóa báo cáo OMC đối với giao dịch kinh doanh vốn hiện hành (mua/bán GTCG, Repo/Reverse Repo, MM)
  1. **Phạm vi**

Áp dụng cho các đơn vị Hội sở tham gia kinh doanh và quản lý rủi ro trên chương trình TMS: B.KDV, B.QLRRTT, TTTT.

* 1. **Tham khảo**
* Kiểm tra lãi suất phi thị trường
* Kiểm tra giá phi thị trường
* Quy định Quản lý rủi ro thị trường

1. **Quy trình nghiệp vụ hiện tại**

**2.1 Đo lường các chỉ số rủi ro thị trường:** Chưa có

**2.2 Công tác OMC đối với giao dịch kinh doanh vốn:** Chưa có

## **Quy trình nghiệp vụ mong muốn**

**3.1 Đo lường RRTT, RRTTr TD**

**3.1.1 Rủi ro thị trường**

* Tính năng:
* Báo cáo cho phép chọn từ ngày đến ngày.
* Chọn Mã TP cần thực hiện định giá hoặc cả danh mục GTCG trên SKD của Ban KDV.
* Báo cáo có thể trích xuất ra excel.
* Diễn giải các trường trong bảng tính:
* Mẫu thông tin GTCG cần định giá: Mỗi mã GTCG là 1 Sheet để thực hiện định giá theo quy định

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên trường** | **Diễn giải** | **Yêu cầu ràng buộc** | | |
| **Định dạng trường** | **Bắt buộc Y/N** | **Ghi chú** |
| 01 | Ngày báo cáo | Chọn từ hệ thống | DD/MM/YYYY | Y | Ngày thực hiện định giá |
| 02 | Mã TP | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 03 | Mệnh giá TP | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND/1 TP |
| 04 | Số lượng TP | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là TP |
| 05 | Lãi suất phát hành (Coupon) | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 0\6 | Kỳ hạn của GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 07 | Ngày phát hành | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 08 | Ngày đáo hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 09 | Tổng số tiền theo HĐ | = Số lượng TP \* Mệnh giá TP | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND |
| 10 | Tên đối tác | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 11 | Margin 3 | =Lãi suất phát hành (coupon) – Lãi suất thị trường tại kỳ hạn tương ứng tại ngày định giá | Dạng số | Y | Chỉ có Margin 3 khi GTCG định giá là TP TCTD (TPCP không có Margin 3) |

* Bảng định giá TPCP và đo lường VAR TPCP (ghi chú cụ thể cách tính): **Phụ lục 01**
* Bảng định giá TP TCTD và đo lường VAR TP TCTD (ghi chú cụ thể cách tính): **Phụ lục 02**

**3.1.2 Rủi ro tập trung tự doanh**

* Tính năng:
* Cho phép chọn theo đối tác giao dịch.
* Báo cáo cho phép chọn từ ngày đến ngày.
* Báo cáo có thể trích xuất ra excel.
* Các bước thực hiện:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **STT** | **Nội dung** | **Ghi chú** |
| Bước 1 | Thu thập số dư phát sinh trong ngày làm việc của từng đối tác trong 03 tháng gần nhất (bao gồm tháng báo cáo và 02 tháng gần nhất liền trước tháng báo cáo) |  |
| Bước 2 | Xác định Tỷ trọng đối tác giao dịch cho từng ngày làm việc trong 03 tháng gần nhất theo công thức  *Lưu ý:* Trường hợp mẫu số tại bất kỳ tỷ trọng quy định tại Điểm a), b), c) Bước này bằng 0 thì tỷ trọng đó sẽ bằng 0%. |  |
| Bước 3 | Tỷ trọng đối tác giao dịch được xác định bằng trung bình số học tỷ trọng đối tác giao dịch của tất cả các ngày làm việc trong 03 tháng gần nhất (bao gồm tháng báo cáo và 02 tháng gần nhất liền trước tháng báo cáo). | Trung bình số học của các tỷ trọng được tính ở Bước 2 |
| Bước 4 | So sánh Tỷ trọng đối tác giao dịch với hạn mức RRTTr TD theo đối tác giao dịch được ban hành trong từng thời kỳ |  |

* Bảng tính chi tiết: **Phụ lục 03. Đo lường Rủi ro tập trung tự doanh**

**3.2 Công tác OMC đối với giao dịch Kinh doanh vốn**

**3.2.1 Kiểm tra giá phi thị trường (giao dịch mua/bán GTCG)**

**- Dữ liệu sử dụng: Dữ liệu giao dịch, Dữ liệu thị trường (VBMA, VNIBOR) từ Reuter do Ban KDV cung cấp**

* Tính năng:
* Chọn danh mục GTCG: TPCP/TP TCTD/Cả hai
* Báo cáo cho phép chọn từ ngày đến ngày.
* Báo cáo có thể trích xuất ra excel.

**Mẫu thông tin giao dịch mua/bán TPCP cần kiểm tra (Sheet “Danh mục TPCP” tại Phụ lục 04)**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên trường** | **Diễn giải** | **Yêu cầu ràng buộc** | | |
| **Định dạng trường** | **Bắt buộc Y/N** | **Ghi chú** |
| 01 | Ngày báo cáo | Chọn từ hệ thống | DD/MM/YYYY | Y | Ngày thực hiện kiểm tra (Sau ngày giao dịch) |
| 02 | Mã GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán TPCP của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 03 | Mệnh giá GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND/1 TP |
| 04 | Số lượng GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là TP |
| 05 | Lãi suất phát hành (Coupon) | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 0\6 | Kỳ hạn của GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 07 | Ngày phát hành TPCP | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 08 | Ngày đáo hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 09 | Tổng giá trị TP | Tổng giá trị TP = Mệnh giá TP \* Số lượng TP | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND |
| 10 | Tên đối tác | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán TPCP của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 11 | Ngày mua bán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 12 | Ngày thanh toán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 13 | Giá trị thanh toán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán TPCP của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 14 | Yield (Lãi suất giao dịch) | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 15 | Kỳ hạn còn lại của GTCG (KHCL) | = Ngày đáo hạn – Ngày mua/bán GTCG | Dạng số | Y |  |
| 15 | Kỳ hạn chuẩn | Xác định xem KHCL có phải kỳ hạn chuẩn theo quy định hay không | Dạng chữ | Y | Tìm kiếm KHCL có phải kỳ hạn chuẩn trong Sheet “Thang kỳ hạn” tại **Phụ lục 04** |
| 16 | Kỳ hạn chuẩn ngắn | Nếu là “Kỳ hạn lẻ”. Tìm kiếm Lãi suất chuẩn trên và Lãi suất chuẩn dưới của các dòng tiền tại ngày định giá trong Sheet "Tổng hợp ĐCLS" tại ngày kiểm tra | Dạng số | Y | Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 04** |
| 17 | Kỳ hạn chuẩn dài | Dạng số | Y |
| 18 | Lãi suất VBMA của Kỳ hạn chuẩn ngắn | Đối với kỳ hạn chuẩn: Lãi suất tham chiếu của TPCP là lãi suất của VMBA trên ĐCLS tại kỳ hạn tương ứng ("Sheet Tổng hợp ĐCLS")  Đối với kỳ hạn lẻ: Lãi suất được xác định bằng phương pháp nội suy tuyến tính giữa mức lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) + Alpha | Dạng số | Y | - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 04**  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 19 | Lãi suất VBMA của Kỳ hạn chuẩn dài | Dạng số | Y |
| 20 | r nội suy ĐCLS | Nội suy tuyến tính giữa mức lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KHCL của GTCG là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 21 | Lãi suất tham chiếu TPCP | Nếu là kỳ hạn chuẩn thì tìm kiếm Lãi suất VBMA kỳ hạn tương ứng tại ngày báo cáo | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KHCL của GTCG là kỳ hạn chuẩn  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 22 | Alpha | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng số | Y | Bằng 0 nếu là Kỳ hạn chuẩn |
| 23 | LSTC (Lãi suất tham chiếu) | **- Đối với kỳ hạn chuẩn**: Lãi suất tham chiếu TPCP  **- Đối với kỳ hạn lẻ**:  r nội suy ĐCLS + Alpha | Dạng số | Y |  |
| 24 | Biên độ | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng số | Y |  |
| 25 | Lãi suất tham chiếu cao nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) + Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 26 | Lãi suất tham chiếu thấp nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) + Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 27 | Khoảng lãi suất hợp lý | Nếu Yeild giao dịch nằm trong [Lãi suất tham chiếu thấp nhất; Lãi suất tham chiếu cao nhất] => GD hợp lý và ngược lại GD phi thị trường | Dạng chữ | Y |  |
| 28 | Đánh giá của Ban QLRRTT | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng chữ | N |  |

**Mẫu thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD cần kiểm tra (Sheet “Danh mục GTCG TCTD” tại Phụ lục 04)**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên trường** | **Diễn giải** | **Yêu cầu ràng buộc** | | |
| **Định dạng trường** | **Bắt buộc Y/N** | **Ghi chú** |
| 01 | Ngày báo cáo | Ngày thực hiện kiểm tra giao dịch | DD/MM/YYYY | Y | Ngày thực hiện kiểm tra |
| 02 | Mã GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 03 | Mệnh giá GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND/1 TP |
| 04 | Số lượng GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là TP |
| 05 | Lãi suất phát hành (Coupon) | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 0\6 | Kỳ hạn của GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 07 | Ngày phát hành GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 08 | Ngày đáo hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 09 | Tổng giá trị GTCG | Tổng giá trị TP = Mệnh giá GTCG \* Số lượng GTCG | Dạng số | Y | Mặc định đơn vị tính là VND |
| 10 | Tên đối tác | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 11 | Ngày hiệu lực HĐ | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 12 | Ngày thanh toán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 13 | Giá trị thanh toán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 14 | Yield (Lãi suất giao dịch) | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán GTCG TCTD của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 15 | Kỳ hạn còn lại của GTCG (KHCL) | = Ngày đáo hạn – Ngày mua bán | Dạng số | Y |  |
| 15 | Kỳ hạn chuẩn | Xác định xem KHCL có phải kỳ hạn chuẩn theo quy định hay không | Dạng chữ | Y | Tìm kiếm KHCL có phải kỳ hạn chuẩn trong Sheet “Thang kỳ hạn” tại **Phụ lục 04** |
| 16 | Mã kỳ hạn | Xác định mã kỳ hạn chuẩn của GTCG theo Sheet “Thang kỳ hạn” | Dạng chữ | Y | Sheet “Thang kỳ hạn” tại **Phụ lục 04** |
| 17 | Kỳ hạn chuẩn ngắn | Nếu là “Kỳ hạn lẻ”. Tìm kiếm Lãi suất chuẩn trên và Lãi suất chuẩn dưới của các dòng tiền tại ngày định giá trong Sheet "Tổng hợp ĐCLS" tại ngày kiểm tra | Dạng số | Y | Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 04** |
| 18 | Kỳ hạn chuẩn dài | Dạng số | Y |
| 19 | Lãi suất VBMA của Kỳ hạn chuẩn ngắn | Đối với kỳ hạn chuẩn: Lãi suất tham chiếu của TPCP là lãi suất của VMBA trên ĐCLS tại kỳ hạn tương ứng ("Sheet Tổng hợp ĐCLS")  Đối với kỳ hạn lẻ: Lãi suất được xác định bằng phương pháp nội suy tuyến tính giữa mức lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) + Alpha | Dạng số | Y | - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 04**  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 20 | Lãi suất VBMA của Kỳ hạn chuẩn dài | Dạng số | Y |
| 21 | r nội suy ĐCLS | Nội suy tuyến tính giữa mức lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KHCL của GTCG là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 22 | Lãi suất tham chiếu TPCP | Nếu là kỳ hạn chuẩn thì tìm kiếm Lãi suất VBMA kỳ hạn tương ứng tại ngày báo cáo | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KHCL của GTCG là kỳ hạn chuẩn  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 23 | Margin 3 | = Lãi suất phát hành (coupon) – Lãi suất VBMA tại ngày phát hành | Dạng số | Y |  |
| 24 | Alpha | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng số | Y | Bằng 0 nếu là Kỳ hạn chuẩn |
| 25 | LSTC (Lãi suất tham chiếu) | **- Đối với kỳ hạn chuẩn**: Lãi suất tham chiếu TPCP + Margin 3  **- Đối với kỳ hạn lẻ**:  r nội suy ĐCLS + Alpha + Margin 3 | Dạng số | Y |  |
| 26 | Biên độ | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng số | Y |  |
| 27 | Lãi suất tham chiếu cao nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) + Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 28 | Lãi suất tham chiếu thấp nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) – Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 29 | Khoảng lãi suất hợp lý | Nếu Yeild giao dịch nằm trong [Lãi suất tham chiếu thấp nhất; Lãi suất tham chiếu cao nhất] => GD hợp lý và ngược lại GD phi thị trường | Dạng chữ | Y |  |
| 30 | Đánh giá của Ban QLRRTT | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng chữ | N |  |

* Bảng tính chi tiết: **xem tại Sheet “Danh mục GTCG TCTD” tại Phụ lục 04**

**3.2.2 Kiểm tra lãi suất phi thị trường (giao dịch MM vay/gửi, Repo/Reverse Repo)**

* Tính năng:
* Báo cáo cho phép chọn từ ngày đến ngày.
* Báo cáo có thể trích xuất ra excel.

**Mẫu thông tin giao dịch MM gửi/vay:**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên trường** | **Diễn giải** | **Yêu cầu ràng buộc** | | |
| **Định dạng trường** | **Bắt buộc Y/N** | **Ghi chú** |
| 01 | Ngày báo cáo | Chọn từ hệ thống | DD/MM/YYYY | Y | Ngày thực hiện kiểm tra (Sau ngày giao dịch) |
| 02 | Loại tiền | Mặc định VND | Dạng chữ | Y |  |
| 03 | Tên đối tác | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 04 | Số dư | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 05 | Hình thức giao dịch | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | Lend/ Borrow | Y |  |
| 06 | Ngày hiệu lực | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 07 | Ngày đáo hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 08 | Lãi suất | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch gửi/vay LNH của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 09 | Kỳ hạn | Ngày đáo hạn – Ngày hiệu lực HĐ | Dạng số | Y |  |
| 10 | Mã kỳ hạn chuẩn | Xác định xem KH có phải kỳ hạn chuẩn theo quy định hay không | Dạng chữ | Y | Tìm kiếm KH có phải kỳ hạn chuẩn trong Sheet “Bảng kỳ hạn” tại **Phụ lục 05** |
| 11 | Kỳ hạn VNIBOR chuẩn (shorter) | Đối với “Kỳ hạn lẻ”: Tìm kiếm kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày định giá theo công thức | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 05** |
| 12 | Kỳ hạn VNIBOR chuẩn (longer) | Đối với “Kỳ hạn lẻ”: Tìm kiếm kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày định giá trong theo công thức | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 05** |
| 13 | LS VNIBOR chuẩn (shorter) | **Đối với kỳ hạn lẻ**: tìm lãi suất của kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày giao dịch | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 14 | LS VNIBOR chuẩn (longer) | **Đối với kỳ hạn lẻ:** tìm lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày giao dịch | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 15 | Biên độ chuẩn (shorter) | **Đối với kỳ hạn lẻ:** tìm biên độ của kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày giao dịch trong **Sheet "Biên độ áp dụng”** | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ |
| 16 | Biên độ chuẩn (longer) | **Đối với kỳ hạn lẻ:** tìm biên độ của kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày giao dịch trong **Sheet "Biên độ áp dụng”** | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ |
| 17 | Biên độ | Đối với kỳ hạn chuẩn:  Tìm biên độ tương ứng tại ngày giao dịch ở **Sheet “Biên độ áp dụng”**  Đối với là kỳ hạn lẻ: Nội suy tuyến tính giữa biên độ của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y |  |
| 18 | Lãi suất tham chiếu (LSTC) | **Đối với kỳ hạn chuẩn:**  Tìm lãi suất tương ứng tại ngày giao dịch ở **Sheet “Data VNIBOR”**  **Đối với là kỳ hạn lẻ:** Nội suy tuyến tính giữa LSTC của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và LSTC kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y |  |
| 19 | Lãi suất tham chiếu cao nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) + Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 20 | Lãi suất tham chiếu thấp nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) – Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 21 | Đánh giá của Ban QLRRTT | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng chữ | N |  |

* Bảng tính chi tiết: **xem tại Sheet “Giao dịch MM” tại Phụ lục 05**

**Mẫu thông tin giao dịch Repo/Reverse Repo:**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên trường** | **Diễn giải** | **Yêu cầu ràng buộc** | | |
| **Định dạng trường** | **Bắt buộc Y/N** | **Ghi chú** |
| 01 | Ngày báo cáo | Chọn từ hệ thống | DD/MM/YYYY | Y | Ngày thực hiện kiểm tra |
| 02 | Loại giao dịch | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 03 | Mã GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 04 | Loại GTCG | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 05 | Loại tiền | Mặc định VND | Dạng chữ | Y |  |
| 07 | Mệnh giá | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 08 | Ngày phát hành | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 09 | Ngày đáo hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 10 | Kỳ hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 11 | Đơn vị kỳ hạn | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 12 | Lãi suất phát hành | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là %   Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 13 | Tên đối tác | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 14 | Số HĐMB | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng chữ | Y |  |
| 15 | Ngày giao dịch lần 1 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 16 | Ngày thanh toán lần 1 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 17 | Số lượng mua/bán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 18 | Tổng mệnh giá mua/bán | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 19 | Giá trị GDHD lần 1 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 20 | Lãi suất repo | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y | * Mặc định đơn vị tính là % * Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 21 | Ngày giao dịch lần 2 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 22 | Ngày thanh toán lần 2 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | DD/MM/YYYY | Y |  |
| 23 | Giá trị GDHD lần 2 | Trích xuất dữ liệu từ thông tin giao dịch mua/bán có kỳ hạn GTCG của Ban KDV | Dạng số | Y |  |
| 24 | Kỳ hạn còn lại (KHCL) | Ngày GD lần 2 – Ngày GD lần 1 | Dạng số | Y |  |
| 25 | Mã kỳ hạn chuẩn | Xác định xem KHCL có phải kỳ hạn chuẩn theo quy định hay không | Dạng chữ | Y | Tìm kiếm KHCL có phải kỳ hạn chuẩn trong Sheet “Bảng kỳ hạn” tại **Phụ lục 05** |
| 26 | Kỳ hạn Repo chuẩn (shorter) | Tìm kiếm kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày kiểm tra theo công thức | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 05** |
| 27 | Kỳ hạn Repo chuẩn (longer) | Tìm kiếm kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày kiểm tra theo công thức | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Tính toán chi tiết tại **Phụ lục 05** |
| 28 | LS Repo chuẩn (shorter) | Tìm lãi suất của kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày giao dịch | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 29 | LS Repo chuẩn (longer) | Tìm lãi suất của kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày giao dịch | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ  - Đơn vị tính là %  Lấy 02 chữ số thập phân sau dấu phẩy |
| 30 | Biên độ chuẩn (shorter) | Tìm biên độ của kỳ hạn chuẩn ngắn hơn tại ngày giao dịch trong **Sheet "Biên độ áp dụng”** | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ |
| 31 | Biên độ chuẩn (longer) | Tìm biên độ của kỳ hạn chuẩn dài hơn tại ngày giao dịch trong **Sheet "Biên độ áp dụng”** | Dạng số | Y | - Chỉ tính khi KH của giao dịch là kỳ hạn lẻ |
| 32 | Biên độ | **Đối với kỳ hạn chuẩn:**  Tìm biên độ tương ứng tại ngày giao dịch ở Sheet “ Biên độ áp dụng”  **Đối với là kỳ hạn lẻ:** Nội suy tuyến tính giữa biên độ của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y |  |
| 33 | Lãi suất tham chiếu (LSTC) | **Đối với kỳ hạn chuẩn:**  Tìm lãi suất tương ứng tại ngày giao dịch ở **Sheet “Data Repo”**  **Đối với là kỳ hạn lẻ**: Nội suy tuyến tính giữa LSTC của kỳ hạn chuẩn dài hơn (Longer) và LSTC kỳ hạn chuẩn ngắn hơn (Shorter) | Dạng số | Y |  |
| 34 | Lãi suất tham chiếu lớn nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) + Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 35 | Lãi suất tham chiếu nhỏ nhất | LSTC (Lãi suất tham chiếu) – Biên độ | Dạng số | Y |  |
| 36 | Đánh giá của Ban QLRRTT | Ban QLRRTT nhập tay | Dạng chữ | N |  |

* Bảng tính chi tiết: **xem tại Sheet “Giao dịch Repo/** **Reverse Repo” tại Phụ lục 05**

**Phụ lục**

Phụ lục 01: Định giá TPCP và đo lường VAR TPCP

Phụ lục 02: Định giá TP TCTD và đo lường VAR TPTCTD

Phụ lục 03. Đo lường Rủi ro tập trung tự doanh

Phụ lục 04. Kiểm tra giá phi thị trường giao dịch mua bán GTCG

Phụ lục 05. Kiểm tra lãi suất phi thị trường giao dịch MM vay/gửi, Repo/Reverse Repo