**YÊU CẦU 1: RỦI RO THANH KHOẢN**

**1. Mục tiêu:**

Xây dựng công cụ tự động hóa đo lường các chỉ số Rủi ro thanh khoản phù hợp với các quy định pháp luật và quy định nội bộ

**2. Mô tả URD**

- Chi tiết mô tả URD dữ liệu và bảng tính xem tại file đính kèm

**3. Kế hoạch công việc**

- Dữ liệu

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. LN | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Hệ thống đáp ứng | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ truy xuất dữ liệu theo mô tả URD |  |
| 1. TM |  |
| 1. Dong lich goc |  |
| 1. Dong lich lai |  |
| 1. Percentile |  |
| 1. MM gửi | Đơn vị đầu mối nghiệp vụ theo dõi tay và cung cấp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ thiết kế bảng biểu để đơn vị nhập |  |
| 1. MM vay |  |
| 1. Chứng khoán |  |
| 1. Thẻ | QLRRTT theo dõi tay từ file cuối cùng do CNTT xuất T9/2017 | QLDACN/TTCNTT thông tin thêm về nguồn dữ liệu cho chính xác. |  |
| Thời gian hoàn thành | | | |  |

- Chi tiết báo cáo/ tỷ lệ, chỉ số rủi ro thanh khoản:

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. Khe hở thanh khoản theo kỳ đáo hạn thực tế | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Mapping, tính toán theo dữ liệu đã tổng hợp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ truy xuất dữ liệu và xử lý, tính toán theo mô tả URD |  |
| 2. MCO |  |
| 3. Stresstest |  |
| 4. Các chỉ số/tỷ lệ |  |
| Thời gian hoàn thành | | | |  |

**YÊU CẦU 2: RỦI RO LÃI SUẤT SỔ NGÂN HÀNG**

**1. Mục tiêu:**

Xây dựng công cụ tự động hóa đo lường các chỉ số Rủi ro lãi suất phù hợp với các quy định pháp luật và quy định nội bộ

**2. Mô tả URD**

- Chi tiết mô tả URD dữ liệu và bảng tính xem tại file đính kèm

**3. Kế hoạch công việc:**

- Dữ liệu

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. LN | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Hệ thống đáp ứng | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ truy xuất dữ liệu theo mô tả URD |  |
| 1. TM |  |
| 1. Dong lich goc |  |
| 1. MM gửi | Đơn vị đầu mối nghiệp vụ theo dõi tay và cung cấp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ thiết kế bảng biểu để đơn vị nhập |  |
| 1. MM vay |  |
| 1. Chứng khoán |  |
| 1. LSTB-Refinitiv | Đơn vị đầu mối nghiệp vụ theo dõi qua hệ thống Refinitiv và cung cấp |  |
| 1. VNIBOR |  |
| 1. Thẻ | QLRRTT theo dõi tay từ file cuối cùng do CNTT xuất T9/2017 | QLĐACN/TTCNTT thông tin thêm về nguồn dữ liệu cho chính xác. |  |
| 1. Zero Curve | Do VCB cung cấp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ thiết kế bảng biểu để đơn vị nhập |  |
| Thời gian hoàn thành | | | |  |

- Chi tiết báo cáo:

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. Đo lường chênh lệch kỳ định lại lãi suất không tích hợp mô hình hành vi | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Mapping, tính toán theo dữ liệu đã tổng hợp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ truy xuất dữ liệu và xử lý, tính toán theo mô tả URD |  |
| 2. Các kịch bản kiểm tra sức chịu đựng (06KB lãi suất) |  |
| 3. Đo lường thay đổi NII |  |
| 4. Đo lường thay đổi EVE |  |
| Thời gian hoàn thành | | | |  |

**YÊU CẦU 3: RỦI RO THỊ TRƯỜNG**

**1. Mục tiêu:**

- Xây dựng công cụ tự động hóa đo lường các chỉ số Rủi ro thị trường phù hợp với các quy định pháp luật và quy định nội bộ

**2. Mô tả URD**

- Chi tiết mô tả URD dữ liệu và bảng tính xem tại file đính kèm

**3. Kế hoạch công việc**

- Dữ liệu:

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. VBMA | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Đơn vị đầu mối nghiệp vụ theo dõi qua hệ thống Refinitiv và cung cấp | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ thiết kế bảng biểu để đơn vị nhập |  |
| 1. VNIBOR |  |
| 1. Danh mục MM gửi | Đơn vị đầu mối nghiệp vụ theo dõi tay và cung cấp |  |
| 1. Danh mục MM vay |  |
| 1. Danh mục GTCG trên SKD |  |
| 1. Danh mục Repo/Reverse Repo |  |
| 1. Thông tin giao dịch trên TT2 khi có phát sinh (Mua/bán GTCG, Repo/Reverse Repo, MM gửi/vay,…) |  |
| Thời gian hoàn thành | | | | |

- Chi tiết báo cáo:

| **Hạng mục** | **Mô tả URD** | **Đánh giá** | **Giải pháp** | **Ghi chú** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1. Định giá và đo lường Var danh mục SKD | Chi tiết theo bảng mô tả đính kèm, đã gửi QLĐACN | Tính toán theo dữ liệu đầu vào được mô tả trong URD | QLDACN/TTCNTT hỗ trợ truy xuất dữ liệu và xử lý, tính toán theo mô tả URD |  |
| 2. Kiểm tra giá, lãi suất phi thị trường (Công tác OMC) |  |
| 3. Đo lường RRTTr TD |  |
| Thời gian hoàn thành | | | | |