

Số: 74/QĐ-VSDC

Hà Nội, ngày 11 tháng 8 năm 2023

QUYẾT ĐỊNH

Ban hành Hướng dẫn tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của Tổng công ty Lưu ký và bù trừ chứng khoán Việt Nam cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh

TỔNG GIÁM ĐỐC

TỔNG CÔNG TY LƯU KÝ VÀ BÙ TRỪ CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM

Căn cứ Luật Chứng khoán ngày 26 tháng 11 năm 2019;

Căn cứ Nghị định số 155/2020/NĐ-CP ngày 31 tháng 12 năm 2020 của Chính phủ về việc quy định chi tiết thi hành một số điều của Luật Chứng khoán;

Căn cứ Quyết định số 26/2022/QĐ-TTg ngày 16 tháng 12 năm 2022 của Thủ tướng Chính phủ về thành lập, tổ chức và hoạt động của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Quyết định số 1275/QĐ-BTC ngày 14 tháng 06 năm 2023 của Bộ trưởng Bộ Tài chính ban hành Điều lệ tổ chức và hoạt động của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Nghị quyết số 09/2023/NQ-HĐTV ngày 10 tháng 8 năm 2023 của Hội đồng Thành viên Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam thông qua việc ban hành các Quy chế hoạt động nghiệp vụ, Hướng dẫn hoạt động nghiệp vụ của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Quyết định số 13/QĐ-HĐTV ngày 10 tháng 8 năm 2023 của Hội đồng Thành viên Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam ban hành Quy chế thành viên bù trừ chứng khoán phái sinh tại Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam;

Theo đề nghị của Trưởng Phòng Công nghệ Thông tin.

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo quyết định này “Hướng dẫn tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh”.



Điều 2. Quyết định này có hiệu lực kể từ ngày ký và thay thế cho Quyết định số 115/QĐ-VSD ngày 31/5/2017 của Tổng giám đốc Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam về việc ban hành Quy định hướng dẫn tham gia kết nối Công giao tiếp trực tuyến của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh.

Điều 3. Giám đốc Chi nhánh tại Tp. Hồ Chí Minh, Trưởng các Phòng, Ban thuộc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam, các tổ chức và cá nhân liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. /

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- HĐTV (để báo cáo);
- Ban TGD;
- BKS;
- Lưu: VT, CNTT (22b).

TỔNG GIÁM ĐỐC



Dương Văn Thanh



**HƯỚNG DẪN THAM GIA KẾT NỐI CÔNG GIAO TIẾP TRỰC TUYẾN
CỦA TỔNG CÔNG TY LƯU KÝ VÀ BÙ TRỪ CHỨNG KHOÁN VIỆT
NAM CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ, THANH TOÁN GIAO DỊCH
CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH**

*(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của
Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)*

**CHƯƠNG I
QUY ĐỊNH CHUNG**

Điều 1. Phạm vi áp dụng

Văn bản này hướng dẫn tham gia kết nối Công giao tiếp trực tuyến của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam (VSDC) cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh đồng thời quy định các giao thức và điện tín giữa hệ thống bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh của VSDC và hệ thống của các Thành viên bù trừ.

Điều 2. Giải thích thuật ngữ

Trong văn bản này, các thuật ngữ sau đây được hiểu như sau:

1. *Cổng giao tiếp trực tuyến*: Là môi trường phần mềm ứng dụng trong đó cho phép VSDC và các Thành viên bù trừ trao đổi trực tiếp các thông tin về hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh giữa hệ thống nghiệp vụ của Thành viên bù trừ và hệ thống của VSDC thông qua các file dữ liệu có cấu trúc theo chuẩn ISO 15022.

2. *Điện nghiệp vụ (điện MT, FileAct)*: Là file dữ liệu chứa các thông tin về giao dịch nghiệp vụ có cấu trúc theo chuẩn ISO 15022 để trao đổi trực tiếp giữa hệ thống nghiệp vụ của Thành viên với hệ thống của VSDC, được xác thực bằng chữ ký số của người có thẩm quyền của VSDC hoặc Thành viên bù trừ và được coi là chứng từ điện tử. Chuẩn điện nghiệp vụ được quy định chi tiết tại **Phụ lục 06** của Quy định này.

3. *Chứng từ điện tử*: Là thông tin về giao dịch nghiệp vụ tại VSDC được tạo ra, gửi đi, nhận và lưu trữ bằng phương tiện điện tử giữa VSDC và Thành viên bù trừ đã được xác thực bằng chữ ký số của người có thẩm quyền của VSDC hoặc Thành viên bù trừ.

4. *Chữ ký số*: Là một dạng chữ ký điện tử được thiết kế theo quy định tại Nghị định 26/2007/NĐ-CP ngày 15/12/2007 của Chính phủ quy định chi tiết thi

hành Luật giao dịch điện tử về chữ ký số và dịch vụ chứng thực chữ ký số mà người có thẩm quyền của VSDC hoặc Thành viên bù trừ sử dụng để xác thực thông tin dữ liệu mà mình gửi đi.

5. *Tổ chức cung cấp dịch vụ chứng thực chữ ký số (CA)*: Là tổ chức cung cấp dịch vụ chứng thực chữ ký số cho cơ quan, tổ chức, cá nhân sử dụng trong các hoạt động công cộng. Hoạt động cung cấp dịch vụ chứng thực chữ ký số công cộng là hoạt động kinh doanh có điều kiện theo quy định của pháp luật.

Điều 3. Các giao dịch và điện nghiệp vụ được thực hiện qua Cổng giao tiếp trực tuyến

1. Danh mục các điện nghiệp vụ thực hiện qua Cổng giao tiếp trực tuyến được quy định tại **Phụ lục 01** văn bản này.

2. Việc áp dụng điện nghiệp vụ trong xử lý các giao dịch nghiệp vụ và tra xuất báo cáo qua Cổng giao tiếp trực tuyến được thực hiện theo các nguyên tắc quy định tại các Quy chế nghiệp vụ tương ứng.

CHƯƠNG II

QUY ĐỊNH ĐỐI VỚI THÀNH VIÊN KHI THAM GIA KẾT NỐI

Điều 4. Điều kiện được tham gia kết nối

1. Địa điểm chính đăng ký kết nối phải là Trung tâm dữ liệu (TTDL) đặt tại Trụ sở chính, Chi nhánh của Thành viên bù trừ đã đăng ký hoạt động với VSDC hoặc TTDL được Thành viên bù trừ thuê đặt hệ thống tại nhà cung cấp dịch vụ. Địa điểm dự phòng kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến phải là TTDL có vị trí địa lý độc lập với điểm kết nối chính của Thành viên bù trừ.

2. Điều kiện về cơ sở vật chất kỹ thuật tại điểm kết nối chính và dự phòng:

2.1. Đường truyền kết nối:

Có thể sử dụng chung hạ tầng và đường truyền kết nối với Cổng giao tiếp trực tuyến hiện có;

Trường hợp thiết lập kết nối mới, Thành viên phải đáp ứng yêu cầu về hạ tầng thiết bị quy định tại Khoản 2.2 Điều này và phải thiết lập 01 đường truyền MPLS tốc độ 01 Mbps do Ban khách hàng tổ chức – Doanh nghiệp – Chi nhánh Tổng Công ty dịch vụ viễn thông – VNPT Vinaphone và 01 đường truyền MPLS tốc độ 01 Mbps do Chi nhánh Công ty TNHH một thành viên viễn thông quốc tế FPT cung cấp với hệ thống của VSDC.

2.2. Các thiết bị và phần mềm tin học:

Phải có đầy đủ các thiết bị tin học đáp ứng yêu cầu thiết lập điểm kết nối, bao gồm:

- 02 Router có cấu hình tối thiểu tương đương Cisco ISR 1000 Series với 02 cổng Ethernet;
- 01 Switch có cấu hình tối thiểu tương đương Cisco Catalyst 1000 Series;
- 02 Converter quang - điện có cấu hình tối thiểu FastEthernet 10/100Mbps;
- Máy Gateway Client có cấu hình tối thiểu tương đương: PC Intel® Core™ i5-10400 (Memory: 8GB, Storage: 256GB Solid-State Drive, 02 Ethernet10/100/1000) hoặc Server HP DL380G10 (Memory: 8GB, Storage: 256GB Solid-State Drive, 02 Ethernet10/100).

2.3. Thành viên phải thực hiện tích hợp các điện nghiệp vụ được quy định chi tiết tại **Phụ lục 06** với hệ thống phần mềm nghiệp vụ phái sinh của Thành viên bù trừ, hoàn thành việc thử nghiệm các giao dịch với VSDC và được VSDC chấp thuận trước khi đưa vào sử dụng.

2.4. Máy Gateway Client của Thành viên không được sử dụng chung với các mục đích khác và không được cài đặt bất kỳ phần mềm nào khác ngoài các phần mềm sau:

- Hệ điều hành: Windows server 2008 hoặc 2012 phiên bản 64 Bit hoặc mới hơn;
- Chương trình diệt virus: Kaspersky EndPoint Security 11 hoặc mới hơn;
- Java: Java Runtime Environment (JDK 1.8);
- Chương trình: GatewayClient do VSDC cung cấp;
- Chương trình Service mix do VSDC cung cấp;
- Phần mềm truyền file giữa hệ thống của Thành viên bù trừ với Gateway Client.

2.5. Có thiết bị dự phòng cho tất cả các thiết bị máy Gateway Client, mạng, hệ thống điện và các thiết bị tin học khác liên quan đến hệ thống Cổng giao tiếp trực tuyến.

3. Phải có 01 chữ ký số đại diện cho doanh nghiệp còn hiệu lực cùng với thiết bị USB PKI Token hoặc thiết bị lưu trữ HSM để lưu chữ ký số được cung cấp bởi tổ chức cung cấp dịch vụ chứng thực chữ ký số do VSDC chỉ định để thực hiện truy cập Cổng giao tiếp trực tuyến.

4. Phải có tối thiểu 02 cán bộ tin học có chuyên môn về mạng máy tính (có chứng chỉ CCNA hoặc tương đương) để làm đầu mối liên hệ và phối hợp về kỹ thuật với VSDC.

Điều 5. Hồ sơ đăng ký kết nối

Hồ sơ đăng ký kết nối tại điểm kết nối chính, dự phòng hoặc thay đổi địa điểm kết nối bao gồm:

1. Bản đăng ký tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến tại điểm kết nối chính, dự phòng (mẫu tại **Phụ lục 02**), Bản đăng ký thay đổi địa điểm kết nối đối với trường hợp thay đổi địa điểm kết nối (mẫu tại **Phụ lục 03**).

2. Bản đăng ký thông tin truy cập Cổng giao tiếp trực tuyến (mẫu tại **Phụ lục 04**).

3. Bản sao giấy chứng nhận chữ ký số đại diện cho doanh nghiệp được cung cấp bởi tổ chức cung cấp dịch vụ chứng thực chữ ký số do VSDC chỉ định và các tài liệu chứng minh cán bộ tin học đủ điều kiện theo quy định tại Khoản 4 Điều 4 của văn bản này.

Điều 6. Hỗ trợ thiết lập kết nối

1. Trong vòng ba (03) ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ đăng ký kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến đầy đủ và hợp lệ (căn cứ vào dấu bưu điện hoặc ngày ký nhận trên sổ công văn tại VSDC), VSDC tiến hành kiểm tra thực tế điều kiện cơ sở vật chất kỹ thuật và niêm phong các thiết bị kết nối của Thành viên bù trừ.

2. Trong vòng ba (03) ngày làm việc sau ngày thực hiện kiểm tra, VSDC gửi cho Thành viên văn bản thông báo kế hoạch thử nghiệm và hướng dẫn cài đặt hệ thống để sử dụng Cổng giao tiếp trực tuyến. Trường hợp điều kiện kỹ thuật của Thành viên bù trừ chưa đáp ứng được yêu cầu, VSDC sẽ gửi văn bản thông báo và nêu rõ các hạng mục chưa đáp ứng yêu cầu.

3. Trong vòng một (01) ngày làm việc kể từ ngày kết thúc đợt thử nghiệm theo kế hoạch, VSDC sẽ gửi văn bản chấp thuận cho Thành viên kết nối. Trường hợp thử nghiệm không đạt yêu cầu, VSDC sẽ thông báo rõ nội dung, lý do để Thành viên bù trừ tiếp tục hoàn thiện.

Điều 7. Thay đổi/hủy thông tin truy cập

Trường hợp Thành viên bù trừ thực hiện thay đổi/hủy thông tin truy cập Cổng giao tiếp trực tuyến, thực hiện theo mẫu tại **Phụ lục 05** Quy định này.

Điều 8. Quyền và nghĩa vụ của Thành viên

1. Quyền của Thành viên:

1.1. Được kết nối và thực hiện các nghiệp vụ qua Cổng giao tiếp trực tuyến khi đáp ứng điều kiện được quy định tại Điều 4 của Quy định này trong thời gian từ 08h00' đến 17h00' các ngày làm việc.

1.2. Được cấp tài khoản đại diện của Thành viên bù trừ để đăng nhập và trao đổi thông tin giao dịch nghiệp vụ giữa hệ thống phần mềm nghiệp vụ phái sinh của Thành viên bù trừ và hệ thống bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh của VSDC.

1.3. Được bảo mật các thông tin đăng nhập và thông tin nghiệp vụ thực hiện qua Cổng giao tiếp trực tuyến.

1.4. Được tham gia vào các chương trình tập huấn và thử nghiệm chức năng Cổng giao tiếp trực tuyến do VSDC tổ chức.

1.5. Được VSDC hỗ trợ về kỹ thuật khi tham gia kết nối.

1.6. Được VSDC gửi lại các điện nghiệp vụ đã gửi và nhận về từ Thành viên bù trừ trong trường hợp hệ thống nghiệp vụ của Thành viên bù trừ gặp sự cố cần hỗ trợ đối soát dữ liệu. Thành viên bù trừ phải có văn bản gửi VSDC, trong đó nêu rõ nguyên nhân và khoảng thời gian yêu cầu gửi lại điện nghiệp vụ.

1.7. Được VSDC kích hoạt điểm kết nối dự phòng trong trường hợp điểm kết nối chính gặp sự cố. Khi điểm kết nối chính gặp sự cố, Thành viên bù trừ phải có văn bản đề nghị VSDC cho sử dụng điểm kết nối dự phòng và Thành viên bù trừ phải thông báo lại VSDC để chuyển xử lý nghiệp vụ sang điểm kết nối chính sau khi khắc phục xong sự cố.

1.8. Được thay đổi địa điểm kết nối chính và dự phòng khi điểm kết nối mới đã đáp ứng đầy đủ các điều kiện quy định tại Điều 4 của văn bản này.

2. Nghĩa vụ của Thành viên bù trừ:

2.1. Tuân thủ Hướng dẫn về việc kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến, chính sách về an ninh bảo mật, các quy định về nghiệp vụ do VSDC ban hành và các quy định pháp luật khác có liên quan.

2.2. Tuân thủ đúng quy định về chuẩn điện nghiệp vụ được quy định tại **Phụ lục 06** của văn bản này.

2.3. Không được thực hiện bất kỳ hành động nào làm ảnh hưởng đến hệ thống của VSDC và của các Thành viên bù trừ khác.

2.4. Bảo mật thông tin đăng nhập hệ thống do VSDC cung cấp và không đăng nhập Cổng giao tiếp trực tuyến bằng thông tin đăng nhập của Thành viên bù trừ khác.

2.5. Chỉ được sử dụng máy Gateway Client để kết nối với Cổng giao tiếp trực tuyến.

2.6. Thành viên phải thông báo cho VSDC bằng văn bản ít nhất trước hai (02) ngày về kế hoạch sửa chữa, bảo trì, thay thế cho các thiết bị tin học và máy tính kết nối.

2.7. Phải sử dụng dải địa chỉ mạng cho các thiết bị theo đúng quy hoạch của VSDC và không có quyền thay đổi các thông số của hệ thống.

2.8. Có nghĩa vụ trả lời các nghi vấn, hợp tác và cung cấp các chứng từ gốc liên quan đến các nghiệp vụ thực hiện trên Cổng giao tiếp trực tuyến khi có yêu cầu của VSDC.

2.9. Có nghĩa vụ lưu trữ các điện nghiệp vụ được ký số sinh ra trong quá trình tạo giao dịch hoặc báo cáo trên Cổng giao tiếp trực tuyến theo quy định lưu trữ đối với chứng từ điện tử. Các điện nghiệp vụ này sẽ được sử dụng trong trường hợp đối chứng những dữ liệu được ký số với VSDC.

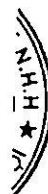
2.10. Chịu sự kiểm tra, giám sát của VSDC về các vấn đề liên quan đến hoạt động của Thành viên bù trừ trên Cổng giao tiếp trực tuyến.

CHƯƠNG III TỔ CHỨC THỰC HIỆN

Điều 09. Điều khoản thi hành

1. Trong quá trình triển khai thực hiện, nếu có vướng mắc, các bên liên quan liên hệ với VSDC để được hướng dẫn, giải quyết.

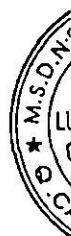
2. Việc sửa đổi, bổ sung văn bản này do Tổng giám đốc VSDC quyết định.



Danh mục các nghiệp vụ và điện nghiệp vụ được thực hiện qua Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh

(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

STT	Chức năng	Điện nghiệp vụ áp dụng
1	Mở/đóng tài khoản ký quỹ chứng khoán phái sinh	MT 598 - Yêu cầu Mở/Đóng tài khoản ký quỹ chứng khoán phái sinh
		MT598 - Xác nhận Mở/Đóng tài khoản ký quỹ chứng khoán phái sinh
		MT598 - Từ chối Mở/Đóng tài khoản ký quỹ chứng khoán phái sinh
2	Mở/đóng tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh	MT 598 - Yêu cầu Mở/Đóng tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh
		MT598 - Xác nhận Mở/Đóng tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh
		MT598 - Từ chối Mở/Đóng tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh
3	Phong tỏa chứng khoán	MT524 - Yêu cầu phong tỏa chứng khoán
		MT508 - Xác nhận kết quả phong tỏa chứng khoán
		MT548 - Từ chối yêu cầu phong tỏa chứng khoán
4	Giải tỏa chứng khoán	MT524 - Yêu cầu giải tỏa chứng khoán
		MT508 - Xác nhận kết quả giải tỏa chứng khoán
		MT548 - Từ chối yêu cầu giải tỏa chứng khoán
5	Nộp ký quỹ bằng chứng khoán cho VSDC	MT542 - Yêu cầu nộp tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT546 - TB giảm số dư để xác nhận yêu cầu nộp tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT544 - TB tăng số dư để xác nhận yêu cầu nộp tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT548 - Từ chối yêu cầu nộp tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
6	Rút ký quỹ bằng chứng khoán	MT542 - Yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT546 - TB giảm số dư để xác nhận yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT544 - TB tăng số dư để xác nhận yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán
		MT548 - Từ chối yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán



STT	Chức năng	Điện nghiệp vụ áp dụng
7	Yêu cầu Thành viên nộp bổ sung ký quỹ	MT598 - Thông báo nộp bổ sung ký quỹ
8	Thông báo kết quả giao dịch chứng khoán phái sinh đã được thế vị cho Thành viên	MT518 - Thông báo kết quả giao dịch đã được thế vị
		MT598 - Thông báo tổng hợp kết quả giao dịch được thế vị cuối ngày
9	Cảnh báo vi phạm tỷ lệ sử dụng tài khoản ký quỹ	MT598 - Cảnh báo tỷ lệ sử dụng tài khoản ký quỹ
10	Cảnh báo vi phạm giới hạn vị thế	MT598 - Cảnh báo vi phạm giới hạn vị thế
11	Cảnh báo vi phạm giới hạn khối lượng mở	MT598 - Cảnh báo vi phạm giới hạn khối lượng mở
12	Chuyển khoản tất toán vị thế, ký quỹ	MT546 - Thông báo giảm tài sản ký quỹ là chứng khoán
		MT544 - Thông báo tăng tài sản ký quỹ là chứng khoán
		MT900 - Thông báo ghi giảm tài sản ký quỹ là tiền của bên chuyển
		MT910 - Thông báo ghi tăng tài sản ký quỹ là tiền của bên nhận
		MT598 - Thông báo tăng/giảm vị thế
13	Bù trừ vị thế trên tài khoản tổng hợp (Omnibus account)	MT598 - Yêu cầu bù trừ vị thế
		MT598 - Xác nhận yêu cầu bù trừ vị thế
		MT598 - Từ chối yêu cầu bù trừ vị thế
14	Chuyển khoản vị thế	MT598 - Thông báo tăng/giảm vị thế
15	Thông báo nghĩa vụ thanh toán lỗ/lãi vị thế (VM) cho Thành viên	MT598 - Thông báo nghĩa vụ thanh toán lỗ/lãi vị thế
16	Thực hiện thanh toán lỗ/lãi vị thế	MT910 - Thông báo Thành viên lỗ đã nộp tiền
		MT900 - Thông báo cắt tiền từ Thành viên lỗ đã nộp tiền
		MT910 - Thông báo chuyển tiền vào tài khoản tiền thanh toán TVBT lãi
		MT900 - Thông báo cắt tiền trên TK tiền thanh toán bên lãi
17	Thanh toán đáo hạn bằng chuyển giao vật chất	MT542 - Yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất
		MT546 - Xác nhận yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất cho bên chuyển cho bên chuyển
		MT544 - Xác nhận yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất cho bên nhận
		MT548 - Từ chối yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất

STT	Chức năng	Điện nghiệp vụ áp dụng
		MT546 - Thông báo chuyển giao chứng khoán
		MT544 - Thông báo nhận chuyển giao chứng khoán
		MT910 - Thông báo ghi tăng tiền trên tài khoản tiền thanh toán TVBT bên mua (do nộp tiền thanh toán hợp đồng đảo hạn)
		MT900 - Thông báo ghi giảm tiền do thanh toán đảo hạn (khi VSDC ghi giảm tiền trên tài khoản tiền thanh toán của bên mua chuyển cho bên bán)
		MT910 - Thông báo ghi tăng tiền do thanh toán đảo hạn trên tài khoản tiền thanh toán của bên bán
		MT900 - Thông báo ghi giảm trên tài khoản tiền thanh toán bên bán khi Ngân hàng thực hiện chuyển tiền từ tài khoản tiền thanh toán sang tài khoản tiền thành viên đăng ký
18	Xử lý mất khả năng thanh toán hàng ngày (VM)	MT103 - Yêu cầu rút tiền ký quỹ để thanh toán VM
		MT900 - Thông báo rút tiền thành công
		MT910 - Thông báo tăng tiền trên tài khoản thanh toán
19	Xử lý mất khả năng thanh toán chuyển giao vật chất	MT900 - Báo NỢ nộp tiền thanh toán chuyển giao vật chất
		MT910 - Báo CÓ nộp tiền thanh toán chuyển giao vật chất
20	Báo cáo tự động và báo cáo theo yêu cầu của Thành viên bù trừ (09 báo cáo)	MT598 - Yêu cầu tra cứu báo cáo
		MT598 - Thông tin chi tiết báo cáo

Mẫu Bản đăng ký tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh
(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

BẢN ĐĂNG KÝ THAM GIA
KẾT NỐI CỔNG GIAO TIẾP TRỰC TUYẾN CỦA VSDC CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ, THANH TOÁN CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH

Kính gửi: Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam

Tên Tổ chức:.....

Tên giao dịch :.....

Tên viết tắt:.....

Địa chỉ Trụ sở chính:.....

Địa chỉ Chi nhánh (nếu có):.....

Điện thoại liên hệ:.....Fax.....

Xét thấy Công ty/Ngân hàng..... đã đáp ứng đầy đủ các điều kiện để tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh, chúng tôi đề nghị được đăng ký tham gia kết nối như sau:

I. Địa điểm đăng ký kết nối:

1. Địa điểm đăng ký điểm kết nối chính:.....

2. Địa điểm đăng ký điểm kết nối dự phòng:.....

II. Cam kết:

Công ty Chứng khoán/Ngân hàng cam kết:

- Tuân thủ tuyệt đối Hướng dẫn tham gia kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh do VSDC ban hành;
- Tuân thủ các quy định hiện hành liên quan đến hoạt động nghiệp vụ của VSDC;

- Đáp ứng các điều kiện về kết nối của VSDC;
- Không có các hành vi làm ảnh hưởng đến hoạt động nghiệp vụ trên hệ thống Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh;
- Cước sử dụng dịch vụ hàng tháng của Công ty Chứng khoán/Ngân hàng tại phía đầu mạng của VSDC sẽ được Công ty Chứng khoán/Ngân hàng thanh toán đầy đủ cho nhà cung cấp kết nối trên cơ sở tổng cước thực tế tại đầu mạng của VSDC phân bổ đều cho tất cả các Công ty Chứng khoán/Ngân hàng tham gia mạng trong tháng đó;
- Chịu hoàn toàn trách nhiệm nếu hệ thống công nghệ thông tin tại Công ty chứng khoán/Ngân hàng chúng tôi phát sinh sự cố làm ảnh hưởng đến hệ thống Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC phục vụ hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh.

..... , ngày tháng năm.....

TỔNG GIÁM ĐỐC/GIÁM ĐỐC

(Chữ ký, họ tên, đóng dấu)

Mẫu đơn xin thay đổi địa điểm kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh
(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

ĐƠN XIN THAY ĐỔI ĐỊA ĐIỂM KẾT NỐI CỔNG GIAO TIẾP TRỰC TUYẾN CỦA VSDC CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ, THANH TOÁN CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH

Kính gửi: Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam

Tên Tổ chức.....

Tên giao dịch :

Trụ sở chính:

Điện thoại:

Fax

Xét thấy Công ty/Ngân hàng..... đã đáp ứng đầy đủ các điều kiện để kết nối Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh tại địa điểm kết nối mới, chúng tôi xin được thay đổi điểm kết nối như sau:

I. Địa điểm kết nối cũ:

II. Địa điểm đăng ký kết nối mới:

III. Lý do thay đổi:

Chúng tôi xin chịu trách nhiệm với các nội dung trên.

.....,ngày.....tháng.....năm.....

TỔNG GIÁM ĐỐC/GIÁM ĐỐC

(Chữ ký, họ tên, đóng dấu)

Mẫu đăng ký thông tin truy cập Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh

(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

THÔNG TIN TRUY CẬP CỔNG GIAO TIẾP TRỰC TUYẾN CỦA VSDC CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ, THANH TOÁN CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH

Kính gửi: Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam

Tên Tổ chức.....

Tên giao dịch :

Trụ sở chính:.....

Điện thoại:

Fax

Chúng tôi xin đăng ký:

1. Thông tin truy cập:

- Tên Tổ chức:

- Điện thoại: Fax:

- Chữ ký số được cấp bởi:

- SerialNr:

2. Cán bộ Tin học:

- Họ tên:..... Chức vụ:

Email:Điện thoại:.....

- Họ tên:..... Chức vụ:

Email:Điện thoại:.....

Chúng tôi xin chịu trách nhiệm với các nội dung đăng ký trên.

.....,ngày.....tháng.....năm.....

TỔNG GIÁM ĐỐC/GIÁM ĐỐC

(Chữ ký, họ tên, đóng dấu)

Mẫu đơn xin thay đổi/hủy thông tin truy nhập Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh
(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

**ĐƠN XIN THAY ĐỔI/HỦY THÔNG TIN TRUY NHẬP
CỔNG GIAO TIẾP TRỰC TUYẾN CỦA VSDC CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ,
THANH TOÁN CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH**

Kính gửi: Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam

Tên Tổ chức

Tên giao dịch :

Trụ sở chính:

Điện thoại:

Fax

Chúng tôi xin thay đổi/hủy thông tin truy cập sau:

I. Thông tin đã đăng ký:

II. Thông tin thay đổi/hủy:

III. Lý do thay đổi/hủy:

Chúng tôi xin chịu trách nhiệm với các nội dung đăng ký trên.

....., ngày.....tháng.....năm.....

TỔNG GIÁM ĐỐC/GIÁM ĐỐC

(Chữ ký, họ tên, đóng dấu)

Phương thức trao đổi và chuẩn điện nghiệp vụ qua Cổng giao tiếp trực tuyến của VSDC cho hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh

(Ban hành kèm theo Quyết định số 74/QĐ-VSDC ngày 11 tháng 8 năm 2023 của Tổng giám đốc Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam)

I. PHƯƠNG THỨC TRAO ĐỔI ĐIỆN NGHIỆP VỤ:

Hệ thống của Thành viên bù trừ (TVBT) sẽ thực hiện việc trao đổi điện nghiệp vụ với hệ thống GateWay của VSDC theo phương thức sau:

- Hệ thống của TVBT sẽ thực hiện gửi và nhận điện nghiệp vụ qua GateWay Client theo phương thức tự động quét để nhận về và gửi file lên hệ thống thư mục được thiết lập trên GateWay Client. Các file phải tuân theo cấu trúc điện FIN được mô tả tại Mục 3.1 và nguyên tắc chuyển đổi tiếng Việt tại Mục 3.2 dưới đây. Cấu trúc thư mục được thiết lập như sau:

Đường dẫn thư mục chính: C:\Program Files\VSDC_GatewayClient\. Chương trình sẽ trở đến thư mục liên quan nghiệp vụ chứng khoán cơ sở và phái sinh, có thể chủ động cấu hình phần này trong file `text\com.fss.esb.client.properties` của phần mềm Gateway Client. Ứng với từng thư mục liên quan nghiệp vụ chứng khoán cơ sở và phái sinh sẽ có các thư mục con: **send**, **receive**, **archive**, và **error**. Các thư mục này phục vụ các mục đích sau:

Thư mục Send: Phần mềm GateWay Client sử dụng thư mục **Send** để làm trạm trung chuyển điện nghiệp vụ gửi từ hệ thống BackOffice của Thành viên bù trừ lên hệ thống GateWay của Thành viên bù trừ. Khi nhân viên nghiệp vụ thực hiện một giao dịch, hệ thống BackOffice của Thành viên bù trừ phải thực hiện tạo một điện tương ứng với giao dịch đó theo quy chuẩn VSDC yêu cầu và chuyển vào thư mục **Send**. Trong một chu kỳ nhất định, phần mềm GateWay Client sẽ tự động quét thư mục này và gửi điện trong thư mục lên hệ thống GateWay của VSDC.

Thư mục Receive: Chứa các điện nghiệp vụ nhận được từ hệ thống GateWay của VSDC gửi về cho hệ thống của Thành viên bù trừ, hệ thống BackOffice của TVBT sẽ phải tự động quét liên tục thư mục này để nhận các điện mới khi có phát sinh.

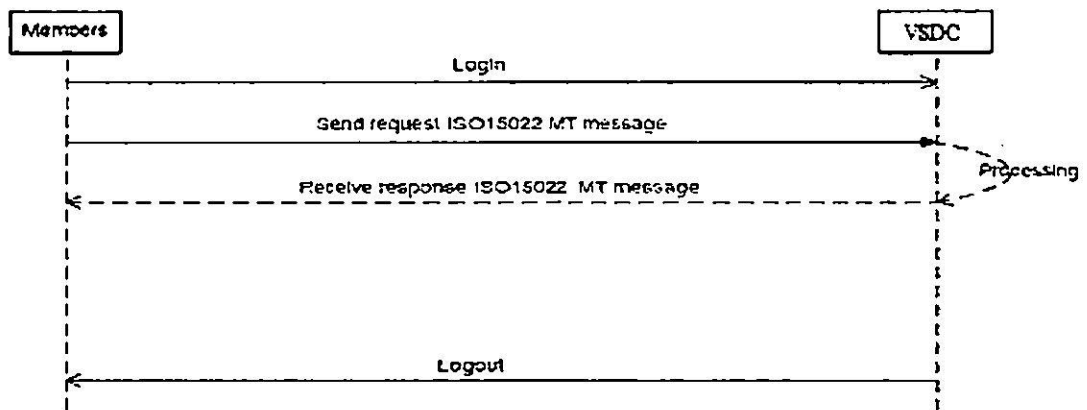
Thư mục Archive: Chứa các tệp tin FIN và FileAct sẽ tự động chuyển vào thư mục archive. Lưu ý các điện gửi đi thành công sẽ tự động chuyển sang thư mục Archive.

Thư mục Error: GateWay Client tự động chuyển điện sang thư mục **Error** trong trường hợp việc gửi điện từ GateWay Client lên GateWay của VSDC bị lỗi.

- Thành viên bù trừ sẽ thực hiện thiết lập kết nối từ GateWay Client tới GateWay của VSDC để gửi và nhận điện nghiệp vụ với VSDC theo phương thức sau:

- Thiết lập kết nối theo phiên làm việc, sử dụng login bằng username/password và khóa (Token key) sử dụng chữ ký số đại diện cho Doanh nghiệp do BKAV cung cấp.
- Hệ thống GateWay Client và GateWay của VSDC sẽ thống nhất một session key chung để mã hóa thông tin trong suốt phiên làm việc.
- Sau khi phiên làm việc được thiết lập, GateWay Client với hệ thống GateWay của VSDC thực hiện trao đổi điện nghiệp vụ tự động và liên tục.

Sơ đồ dưới đây mô tả kết cấu phiên làm việc giữa GateWay Client với hệ thống GateWay của VSDC:



1. Cấu trúc File FIN

1.1. Quy định về cấu trúc điện FIN chuẩn gửi lên VSDC

Các điện nghiệp vụ trao đổi giữa hệ thống của VSDC và TVBT được thể hiện dưới dạng điện FIN (File dữ liệu .fin). Một điện FIN gửi lên hệ thống VSDC gồm những BLOCK sau:

```

{1: BASIC HEADER BLOCK}
{2: APPLICATION HEADER BLOCK}
{4: TEXT BLOCK}
{5: TRAILER BLOCK}
  
```

Quy định nội dung của các BLOCK như sau:

- Block 1: {1: BASIC HEADER BLOCK}

```
{1: F 01 BANKBEBBAXXX2222 123456}
```

```
(a) (b) (c) (d) (e) (f)
```

(a) Block Identifier

Điền giá trị '1'.

(b) Application Identifier

Điền giá trị 'F'.

(c) Service Identifier

Điền giá trị '01'.

(d) Sender's Financial Entity Identifier with Logical Terminal Identifier (always A)
Giá trị BICCODE của bên gửi

(e) Session Number
Mã phiên

(f) Input Sequence Number (ISN)
Số thứ tự của điện gửi trong phiên (tự tăng)

Ghi chú: Trong 1 phiên, TVBT phải đảm bảo các điện gửi lên phải khác nhau về số thứ tự trong phiên

- Block 2: {2: APPLICATION HEADER BLOCK}

{2:I}{103}VSDCSVN06XXXXX{X}{X}{X}

{a}{b}{c}{d}{e}{f}{g}

(a) Block Identifier
Điền giá trị '2:'.

(b) Input Identifier
Điền giá trị 'I'.

(c) Message Type
Điền giá trị mã điện MT

(d) Receiver's Financial Entity Identifier with Logical Terminal Identifier (always X)
Địa chỉ bên nhận, thông thường là VSDC BICCODE

(e) Message Priority
Giá trị là: U (Khẩn) hoặc N (Thông thường)

(f) Delivery monitoring
Giá trị là 1 hoặc 3 cho Message Priority=U: 2 hoặc <null> cho Message Priority là N

(g) Obsolescence Period (optionally)

Tùy chọn của Block 2. Nếu có giá trị sẽ điền là 020

- Block 4: {4: TEXT BLOCK}

Điền nội dung điện.

Ghi chú: Tất cả các Ví dụ nêu trong quy trình nghiệp vụ dưới đây chỉ đưa thông tin trong Block này.

- Block 5: {5: TRAILER BLOCK}

Không quy định thông tin (điền theo mẫu trong Ví dụ dưới)

Ví dụ:

{1:F01VSDCCTBVNAXXX0020000021}{2:1500VSDCSVN06XXXXXN}{4:}{5:{MAC:00000000}{CHK:F1DBCA886BBF}{TNG:}}

1.2. Quy định về cấu trúc điện FIN gửi về cho Thành viên bù trừ

Các điện nghiệp vụ trao đổi giữa hệ thống của VSDC và Thành viên bù trừ được thể hiện dưới dạng điện FIN (File dữ liệu .fin). Một điện FIN gửi lên hệ thống VSDC gồm những BLOCKs tương tự như mô tả ở mục 1.1 nhưng với một số điểm khác biệt ở BLOCK1 và BLOCK 2:

- Block 1: {1: BASIC HEADER BLOCK}

{1:F 01 VSDCSVN06AXXX 2222 123456}

(a)(b)(c)(d) (e) (f)

(a) Block Identifier

Giá trị là '1'.

(b) Application Identifier

Giá trị là 'F'.

(c) Service Identifier

Giá trị là '01'.

(d) Sender's Financial Entity Identifier with Logical Terminal Identifier (always A).
BICCODE của VSDC là VSDCSVN06

(e) Output Session Number

4 ký tự số đại diện cho phiên trao đổi

(f) Output Sequence Number (OSN)

Số thứ tự của điện gửi trong phiên (tự tăng)

Ghi chú: Trong 1 phiên, số thứ tự này là duy nhất.

- Block 2: {2: APPLICATION HEADER BLOCK}

{2:O 103 1511010606 BANKVNVVAXXX0325013085 010515 1149}

(a)(b)(c)(d) (e) (f) (g)

(a) Số hiệu block, lấy giá trị là 2

(b) O cho "output", hoặc nhận từ bên gửi

(c) Loại điện

(d) Thời điểm gửi tính theo mốc thời gian của bên gửi

(e) INPUT SEQUENCE NUMBER: gồm BICCODE bên gửi, số hiệu phiên và số thứ tự của điện

(f) Ngày nhận theo mốc thời gian bên nhận

(g) Giờ nhận theo mốc thời gian bên nhận

1.3. Quy định mã VSDC BICCODE

Mã VSDC BICCODE cấp cho Thành viên bù trừ:

Mã BICCODE của các TVBT gồm 8 ký tự được cấp theo nguyên tắc sau:

VSDC[3 ký tự Tên viết tắt của Thành viên bù trừ][XX]

Ví dụ: VSDCSSIXX, VSDCHSCXX

Trong trường hợp tên viết tắt của Thành viên bù trừ nhiều hơn 3 ký tự sẽ thay thế các ký tự lớn hơn 3 vào các ký tự X phía sau. Ví dụ: VSDCBVSCX, VSDCACBSX, VSDCFPTSX

Mã VSDC BICCODE của VSDC cho CCP: VSDCSVN06

1.4. ACK/NAK message from VSDC

Nội dung điện ACK/NAK bao gồm 02 phần chính: Phần ACK/NAK và nội dung điện MT nghiệp vụ Client gửi lên.

Cấu trúc thông tin phần ACK/NAK gồm Block 1 (Basic Header) và Block 4 (Text Block)

Block 1. Tương tự điện nghiệp vụ gửi từ Thành viên bù trừ lên VSDC nhưng (c) lấy giá trị là 21

```
{1:F21BANKBEBBAXXX2222123456}
```

```
{a}{b}{c}{d}{e}{f}
```

Block 4. Tổ chức như sau

Tag	Field	Description
177	date –time	Thời gian điện ACK/NAK phản hồi
451	accept-reject	0 = accepted (ACK) 1 = rejected (NAK)
405	rejection-reason	Chi tiết lỗi theo BẢNG 1 nếu giá trị của thẻ 451=1

Ví dụ điện NAK

```
{1:A21VNDZBET2AXXX0018000015}{4:{177:9703051524}{451:1}{405:H80}}
```

{1:A21VNDZBET2AXXX0018000015}	Basic Header
{4:{177:9703051524}}	Text Block
{451:1}	The message is rejected...
{405:H80}}	because of delivery option error (H80).

Ví dụ điện ACK gửi về TVBT

```
{1:F21VSDCCTBXXAXXX0020000021}{4:{177:20140314 17:28:37}{451:0}}}{1:F01VSDCCTBXXAXXX0020000021}{2:I598VSDCSVN06  
AXXXN}{4:  
{5:{MAC:00000000}{CHK:F1DBCA886BBF}{TNG:}}}
```

Ví dụ điện NAK gửi về TVBT

```
{1:F21VSDCCTBXXAXXX0020000021}{4:{177:20140314 17:27:49}{451:1}{405:NAK}}
```

```
[REQUESTID:
duplicate]]}}{1:F01VSDCCFBXXAXXX0020000021}{2:I598VSDCSVN06AXXX
N}{4:
-}{5:{MAC:00000000}{CHK:F1DBCA886BBF}{TNG:}}
```

2. Quy định về bộ ký tự hợp lệ và quy tắc chuyển đổi Tiếng Việt

2.1. Bộ ký tự hợp lệ

Các ký tự sau được coi là hợp lệ sử dụng trong nội dung của điện nghiệp vụ:

```
abcdefghijklmnopqrstuvwxyz
ABCDEFGHIJKLMNOPQRSTUVWXYZ
0123456789
/ - ? : ( ) . , ' +
<Cr> (<carriage return>) <Space>
```

2.2. Quy tắc chuyển đổi Tiếng Việt:

Theo qui tắc này các ký tự tiếng Việt sẽ không được phép xuất hiện trực tiếp nên phải có nguyên tắc áp dụng để chuyển đổi từ tiếng Việt thành các ký tự latin.

Luật chuyển đổi từ chữ cái tiếng Việt sang ký tự latin thể hiện ở bảng dưới. Theo đó bên gửi sẽ phải thực hiện chuyển đổi từ tiếng Việt sang ký tự latin và bên nhận sẽ thực hiện chuyển đổi ngược lại.

Để báo cho bên nhận biết để thực hiện chuyển đổi, bên gửi sẽ sử dụng thêm ký tự chấm hỏi (?) vào trước và sau ký tự cần chuyển đổi.

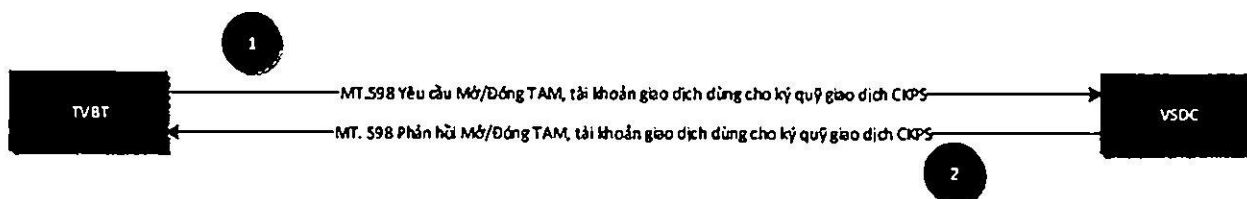
Mỗi ký tự tiếng Việt cần chuyển đổi sẽ ánh xạ một-một với nhóm ký tự latin tương ứng (theo nguyên tắc đánh máy telex của bộ gõ tiếng Việt đang áp dụng hoặc là mã 4 ký tự unicode Basic Latin và Latin-1 Supplement – tham khảo mô tả cụ thể bộ mã unicode này tại địa chỉ https://en.wikipedia.org/wiki/List_of_Unicode_characters).

Độ dài ký tự sẽ được tính trên cơ sở chuỗi ký tự Latin sau khi được chuyển đổi theo quy định tại **BẢNG 2**.

II. ĐẶC TẢ CHI TIẾT ĐIỆN NGHIỆP VỤ CHO HOẠT ĐỘNG BÙ TRỪ, THANH TOÁN GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN PHÁT SINH

1. Đăng ký thông tin tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh (CKPS) cho nhà đầu tư trên hệ thống của VSDC

1.1 Mở/đóng tài khoản giao dịch cho mục đích giao dịch và ký quỹ CKPS



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: TVBT gửi điện MT598. Yêu cầu mở/đóng tài khoản giao dịch cho ký quỹ và giao dịch CKPS.
- Bước 2: Cán bộ VSDC nhận điện, xử lý nghiệp vụ và phản hồi bằng điện MT598. Xác nhận yêu cầu mở/đóng tài khoản giao dịch cho ký quỹ và giao dịch CKPS.

MT598 -Yêu cầu mở/đóng tài khoản giao dịch cho ký quỹ và giao dịch CKPS

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu giao dịch: Đây là số hiệu tham chiếu của bên gửi (TVBT). Hệ thống VSDC.STP kiểm soát tính loại điện và số hiệu tham chiếu phải là duy nhất.	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 600	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị TAM	73x	3
Bắt đầu khối: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị là: NEWM	4!c	5

M	22H	ACCT	Account Process Instruction	Chức năng: Mở tài khoản: ACCT//AOPN Đóng tài khoản: ACCT//ACLS	4!c//4!c	6
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo yêu cầu (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	7
M	16S	GENL				8
Kết thúc khối: Thông tin chung						
Bắt đầu khối: Thông tin chi tiết						
M	16R	REGDET				9
M	97A	SAFE		Số tài khoản giao dịch của NĐT	:4!c//35x	10
M	95Q	INVE		Tên đầy đủ của NĐT	:4!c//4*35x	11
M	95S	ALTE	Alternate ID	Thông tin đăng ký sở hữu, loại đăng ký sở hữu 4!c đầu là qualifier [8c] lấy giá trị VISD cho VSDC 4!c sau là Loại đăng ký sở hữu IDNO: Chứng minh thư VSDCT: Hộ chiếu CORP: Giấy phép kinh doanh OTHR: Chứng thư khác FIIN: Mã Trading Code cho tổ chức nước ngoài ARNU: Mã Trading Code cho cá nhân nước ngoài GOVT: Cơ quan chính phủ 2!a là Mã quốc gia theo chuẩn ISO 3166 (http://www.iso.org/iso/country_codes.htm) Dựa vào thông tin loại đăng ký sở hữu và quốc	4!c/8c/4!c/2!a/30x	12

				tịch sẽ suy ra Loại hình cổ đông. VD: 3-Cá nhân trong nước 95S::ALTE/VISD/IDNO/VN/123456789 (Cá nhận trong nước dùng chứng minh thư) 3-Cá nhân trong nước 95S::ALTE/VISD/ VSDCT /VN/123456789 (Cá nhận trong nước dùng hộ chiếu) 4-Cá nhân nước ngoài 95S::ALTE /VISD/VSDCT/JP/123456789 (Cá nhận nước ngoài dùng hộ chiếu) 4-Cá nhân nước ngoài 95S::ALTE /VISD/ARNU/JP/123456789 (Cá nhận nước ngoài dùng trading code) 5-Pháp nhân trong nước 95S::ALTE/VISD/CORP/VN/123456789 6- Pháp nhân nước ngoài 95S::ALTE/VISD/FIIN/JP/123456789 7 – Nhà nước 95S::ALTE/VISD/GOVT /VN/123456789		
M	98A	ISSU		Ngày cấp CMT/hộ chiếu/giấy phép (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	13
O	94G	ISSU		Nơi cấp CMT/hộ chiếu/giấy phép	:4!c//2*35x	14
O	94G	EMAI		Địa chỉ email Ký tự @ thay bằng (at)	:4!c//2*35x	15
O	94G	PHON		Số điện thoại	:4!c//2*35x	16

M	94G	ADDR		Địa chỉ	:4!c//5*35x	17
M	70E	ADTX		Account numbers: Số tài khoản giao dịch – bắt buộc phải có. Ví dụ: :ADTX//TA//001C123456 Netted/Not-Netted Nếu là mở tài khoản bắt buộc lấy giá trị: NETT//OMNI là tài khoản Omnibus (Not – netted) NETT//NETT là netted Type Loại hình tài khoản lấy một trong các giá trị sau: Cá nhân trong nước = TYPE//DOMIND Cá nhân nước ngoài = TYPE//FORIND Tổ chức trong nước = TYPE//DOMCORP Tổ chức nước ngoài = TYPE//FORCORP	:4!c//10*35x	18
M	16S	REGDET				19
End of Block: Detail request information						

MT598 - Xác nhận kết quả mở/đóng tài khoản giao dịch cho kỳ quỹ và giao dịch CKPS

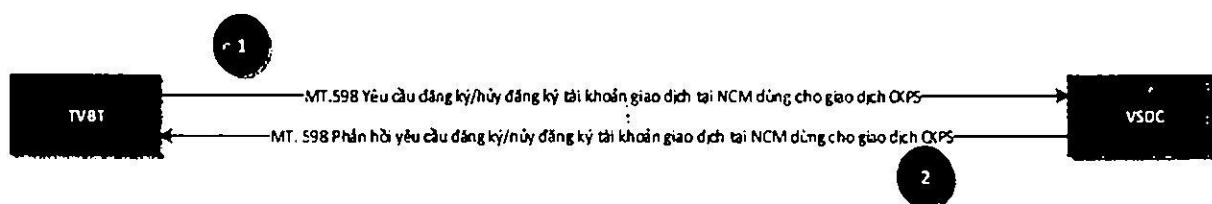
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu giao dịch: Đây là số hiệu tham chiếu của VSDC trả lời	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 601	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Giá trị là TAM	73x	3
Bắt đầu khối: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4

M	23G		Function of the Message	Giá trị là NEWM	4!c	5
M	22H	ACCT	Account Process Instruction	Chức năng: Mở tài khoản: ACCT//AOPN Đóng tài khoản: ACCT//ACLS	4!c//4!c	6
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	7
M	16R	LINK				8
M	20C	RELA		Tham chiếu đến số hiệu yêu cầu ở trường 20 ở điện yêu cầu liên quan	:4!c//16x	9
M	16S	LINK				10
M	16S	GENL				11
Kết thúc khối: Thông tin chung						
Bắt đầu khối: Trạng thái						
M	16R	STAT				12
M	25D	IPRC		Giá trị phản hồi PACK: Đồng ý REJT : Từ chối	:4!c//4a	13
O	70D	REAS		Nguyên nhân từ chối nếu giá trị của trường 25D=IPRC//REJT	:4!c//6*35 x	14
O	70E	ADTX		Account numbers: Số tài khoản giao dịch – bắt buộc phải có. Ví dụ: • :ADTX//TA//001C 123456 Số tài khoản ký quỹ tại VSDC. Ví dụ: • MA//001C123456	:4!c//6*35 x	15

				Số định danh tại CCP. Ví dụ: - CA/VSDC00000001 Netted/Not-Netted Nếu là mở tài khoản bắt buộc lấy giá trị: NETT//OMNI là tài khoản Omnibus (Not – netted) NETT//NETT là netted Type Loại hình tài khoản lấy một trong các giá trị sau: - Cá nhân trong nước = TYPE//DOMIND - Cá nhân nước ngoài = TYPE//FORIND - Tổ chức trong nước = TYPE//DOMCORP - Tổ chức nước ngoài = TYPE//FORCORP		
M	16S	STAT				16
Kết thúc khối: Trạng thái						

1.2 Đăng ký/hủy đăng ký tài khoản giao dịch CKPS

(*) trường hợp nhà đầu tư sử dụng Tài khoản giao dịch (TKGD) mở tại Thành viên không bù trừ (TVKBT) và thực hiện bù trừ trên tài khoản ký quỹ mở tại TVBT



Thứ tự thực hiện:

- TVBT gửi điện MT598. Yêu cầu đăng ký/hủy đăng ký tài khoản giao dịch tại TVKBT dùng cho giao dịch CKPS
- VSDC nhận và phản hồi bằng điện MT598. Phản hồi yêu cầu đăng ký/hủy đăng ký tài khoản giao dịch tại TVKBT dùng cho giao dịch CKPS

MT598 - Yêu cầu đăng ký/hủy đăng ký tài khoản giao dịch tại TVKBT dùng cho giao dịch CKPS

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu giao dịch: Đây là số hiệu tham chiếu của bên gửi (TVBT). Hệ thống VSDC.STP kiểm soát tính loại điện và số hiệu tham chiếu phải là duy nhất.	16x	1
M	12		Sub-MessageType	Lấy giá trị 602	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị TAT	73x	3
Bắt đầu khối: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị là: NEWM	4!c	5
M	22H	ACCT	Account Process Instruction	Chức năng: Đăng ký: ACCT//AOPN Hủy đăng ký: ACCT//ACLS	4!c//4!c	6
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo yêu cầu (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	7
M	16S	GENL				8
Kết thúc khối: Thông tin chung						
Bắt đầu khối: Thông tin chi tiết						
M	16R	REGDET				9
M	97A	SAFE		Số tài khoản ký quỹ CKPS của NĐT	:4!c//35x	10
M	95Q	INVE		Tên đầy đủ của NĐT	:4!c//4*35x	11

Status	Tag	Qualifier	Full Name	Description	Content	No.
M	95S	ALTE	Alternate ID	Thông tin đăng ký sở hữu, loại đăng ký sở hữu 4!c đầu là qualifier [8c] lấy giá trị VISD cho VSDC 4!c sau là Loại đăng ký sở hữu IDNO: Chứng minh thư VSDCT: Hộ chiếu CORP: Giấy phép kinh doanh OTHR: Chứng thư khác FIIN: Mã Trading Code cho tổ chức nước ngoài ARNU: Mã Trading Code cho cá nhân nước ngoài GOVT: Cơ quan chính phủ 2!a là Mã quốc gia theo chuẩn ISO 3166 (http://www.iso.org/iso/country_codes.htm) Dựa vào thông tin loại đăng ký sở hữu và quốc tịch sẽ suy ra Loại hình cổ đông. VD: 3-Cá nhân trong nước 95S::ALTE/ VISD/IDNO/VN/123456789 (Cá nhân trong nước dùng chứng minh thư) 3-Cá nhân trong nước 95S::ALTE/ VISD/ VSDCT /VN/123456789 (Cá nhân trong nước dùng hộ chiếu)	4!c/8c/4!c/ 2!a/30x	12

				4-Cá nhân nước ngoài 95S::ALTE/VISD/VSDCT/JP/123456789 (Cá nhận nước ngoài dùng hộ chiếu) 4-Cá nhân nước ngoài 95S::ALTE/VISD/ARNU/JP/123456789 (Cá nhận nước ngoài dùng trading code) 5-Pháp nhân trong nước 95S::ALTE/VISD/CORP/VN/123456789 6- Pháp nhân nước ngoài 95S::ALTE/VISD/FIIN/JP/123456789 7- Nhà nước 95S::ALTE/VISD/GOVT/VN/123456789		
M	98A	ISSU		Ngày cấp CMT/hộ chiếu/giấy phép (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	13
O	94G	ISSU		Nơi cấp CMT/hộ chiếu/giấy phép	:4!c//2*35x	14
O	94G	EMAI		Địa chỉ email Ký tự @ thay bằng (at)	:4!c//2*35x	15
O	94G	PHON		Số điện thoại	:4!c//2*35x	16
M	94G	ADDR		Địa chỉ	:4!c//5*35x	17
M	70E	ADTX		Account numbers: Số tài khoản giao dịch tại NCM được đăng ký/hủy đăng ký – bắt buộc phải có. Ví dụ: :ADTX//TA//001C123456 Netted/Not-Netted	:4!c//10*35x	18

Start	Tag	Qualifier	Field Name	Description	Content	No.
				Nếu là mở tài khoản bắt buộc lấy giá trị: NETT//OMNI là tài khoản Omnibus (Not – netted) NETT//NETT là netted Type Loại hình tài khoản lấy một trong các giá trị sau: • Cá nhân trong nước = TYPE//DOMIND • Cá nhân nước ngoài = TYPE//FORIND • Tổ chức trong nước = TYPE//DOMCOR P • Tổ chức nước ngoài = TYPE//FORCOR P		
M	16S	REGDET				19
End of Block: Detail request information						

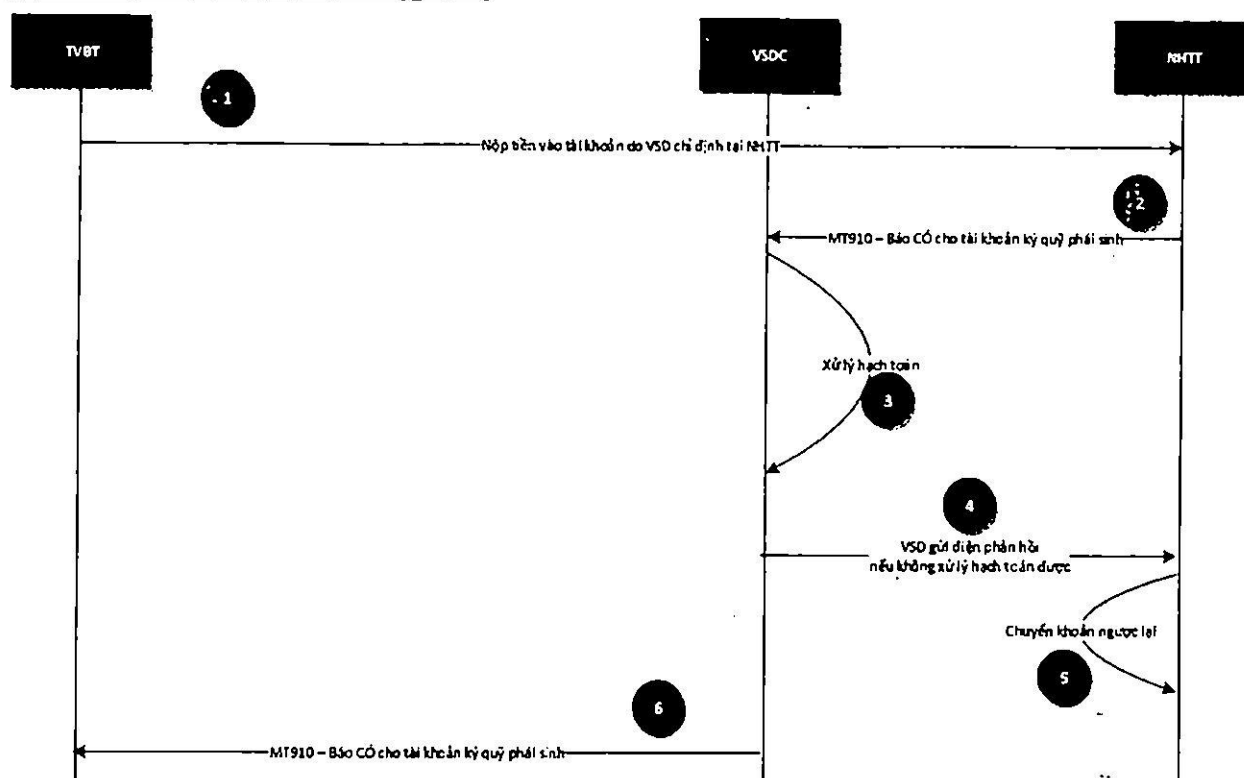
MT598 - Xác nhận kết quả đăng ký/hủy đăng ký tài khoản giao dịch tại TVKBT dùng cho giao dịch CKPS

Start	Tag	Qualifier	Field Name	Description	Content	No.
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu giao dịch: Đây là số hiệu tham chiếu của VSDC trả lời	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 603	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Giá trị là TAT	73x	3
Bắt đầu khối: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	23G		Function of the Message	Giá trị là NEWM	4!c	5

M	22H	ACCT	Account Process Instruction	Chức năng: Đăng ký: ACCT//AOPN Hủy đăng ký: ACCT//ACLS	:4!c//4!c	6
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	7
M	16R	LINK				8
M	20C	RELA		Tham chiếu đến số hiệu yêu cầu ở trường 20 ở điện yêu cầu liên quan	:4!c//16x	9
M	16S	LINK				10
M	16S	GENL				11
Kết thúc khối: Thông tin chung						
Bắt đầu khối: Trạng thái						
M	16R	STAT				12
M	25D	IPRC		Giá trị phản hồi PACK: Đồng ý REJT : Từ chối	:4!c//4a	13
O	70D	REAS		Nguyên nhân từ chối nếu giá trị của trường 25D=IPRC//REJT	:4!c//6*35x	14
O	70E	ADTX		Account numbers: Số tài khoản giao dịch – bắt buộc phải có. Ví dụ: • :ADTX//TA//001C123456 Số tài khoản ký quỹ tại VSDC. Ví dụ: • MA//001C123456 Số định danh tại CCP. Ví dụ: • CA/VSDC00000001 Netted/Not-Netted Nếu là mở tài khoản bắt buộc lấy giá trị: NETT//OMNI là tài khoản Omnibus (Not – netted)	:4!c//6*35x	15

2. Nộp/rút ký quỹ

2.1. TVBT nộp ký quỹ bằng tiền



Trình tự thực hiện:

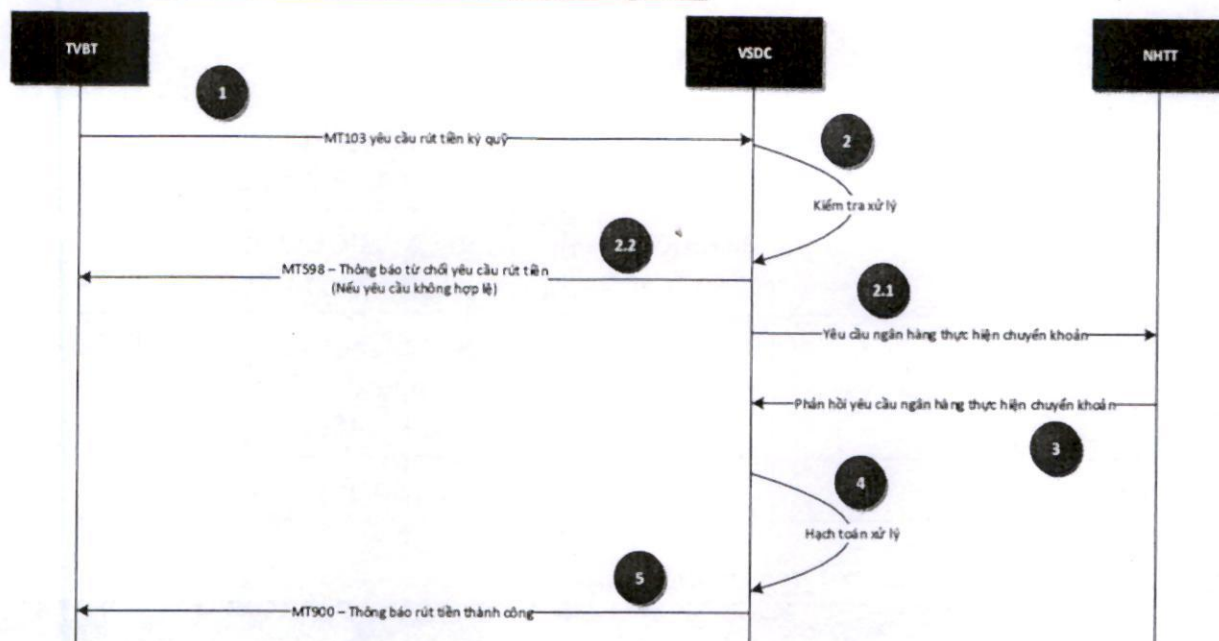
- Bước 1: TVBT nộp tiền vào tài khoản tiền ký quỹ đứng tên VSDC tại Ngân hàng thanh toán (NHTT) - VIETINBANK;
- Bước 2: NHTT gửi báo CỎ cho VSDC (điện MT910. Báo CỎ từ ngân hàng)
- Bước 3: VSDC xử lý hạch toán ghi tăng tiền ký quỹ. Đối với trường hợp hạch toán không thành công thực hiện riêng quy trình theo bước 4 & bước 5:
- *Bước 4: Trường hợp hạch toán không thành công (do số tài khoản không tồn tại trên hệ thống VSDC), VSDC gửi điện phản hồi MT198 cho VIETINBANK (kèm mã lỗi).*
- *Bước 5: VIETINBANK thực hiện chuyển khoản hoàn trả cho TVBT lại số tiền đã nộp.*
- Bước 6: Sau khi hạch toán thành công VSDC gửi điện thông báo ghi tăng tiền ký quỹ cho từng tài khoản ký quỹ của TVBT/NHĐT (điện MT910. Báo CỎ cho tài khoản ký quỹ phải sinh) và kết thúc.

Lưu ý: Trường hợp TVBT phát hiện chuyển nhầm ký quỹ (ví dụ: NHĐT A → NHĐT B) → TVBT phải thực hiện giao dịch rút/nộp ký quỹ để điều chỉnh lại.

MT910 – Báo CỐ từ VSDC (VSDC thông báo cho TVBT về ghi tăng tài khoản NĐT)

Field No.	Field	Field Name	Description	Content	No.
M	20	Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21	Related Reference	Số hiệu tham chiếu báo CỐ của ngân hàng	16x	2
M	25	Account Identification	Số tài khoản tại ngân hàng được ghi tăng số dư Là tài khoản BICCODE.C hoặc BICCODE.P tùy theo nộp tiền cho khách hàng hay tự doanh	35x	3
M	32A	Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a17d	4
M	52A		BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72	Sender to Receiver information	<u>Nội dung diễn giải của ngân hàng</u> IM//001C123456 (VSDC qui định cho TVBT điền nội dung này khi nộp tiền ký quỹ cho NĐT/tự doanh)	73x	6

2.2. TVBT yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng tiền



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: TVBT gửi điện MT103 yêu cầu rút tài sản ký quỹ bằng tiền đến VSDC
- Bước 2: Hệ thống VSDC kiểm tra tính hợp lệ của yêu cầu rút:
 - 2.1. Hợp lệ: Phong tỏa số dư rút trên hệ thống & Yêu cầu VIETINBANK thực hiện chuyển tiền bằng điện MT103 (chuyển sang bước 3).
 - 2.2. Không hợp lệ: Thông báo TVBT từ chối yêu cầu rút tiền bằng điện MT598
- Bước 3: VIETINBANK xác nhận với VSDC chuyển khoản thành công bằng điện MT900
- Bước 4: VSDC xử lý hạch toán
- Bước 5: VSDC gửi điện MT900 cho TVBT thông báo rút tiền thành công.

MT103 – Yêu cầu rút tiền ký quỹ

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu yêu cầu của TVBT	16x	1
M	23B	CRED	Bank Operation Code		4!c	2
M	32A			Ngày hiệu lực/Loại tiền/Số tiền	6!n3!a15d	3

M	50K		Ordering Customer	Thông tin bên chuyển Lấy giá trị BICCODE.P hoặc BICCODE.C tùy theo tài khoản được rút là của tự doanh hay khách hàng	34x	4
M	59		Beneficiary Customer	Lấy giá trị BICCODE.R	34x	5
M	70		Remittance information	IM//Số tài khoản ký quỹ phải sinh tự doanh/NĐT (ví dụ 001C123456)	35x	6
M	71A			Lấy giá trị BEN	3!a	7

MT900 – Thông báo rút tiền thành công

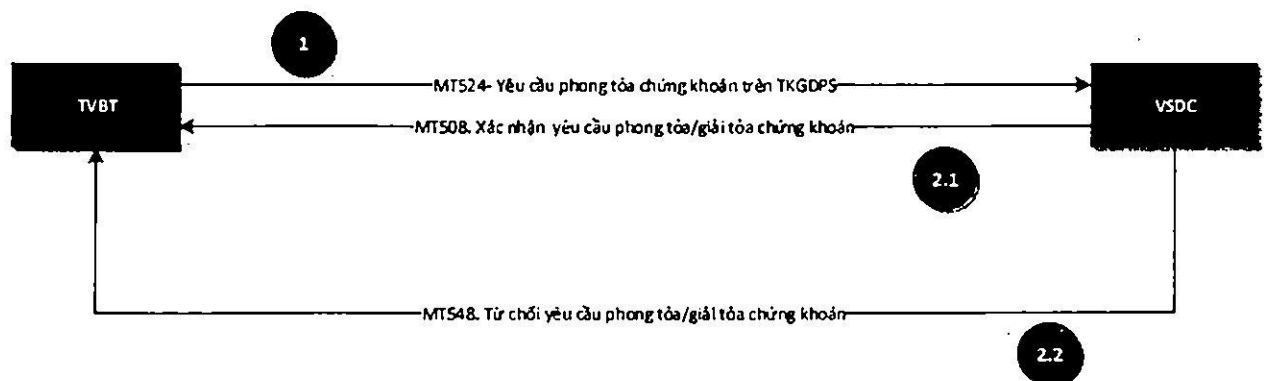
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu đến yêu cầu rút tiền của TVBT (trường 20 của MT103)	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng nhận tiền (Trường 50K của MT103)	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Số tài khoản ký quỹ của NĐT thực hiện rút tiền (Trường 70 của MT103)	6*35x	6

MT598 – Thông báo từ chối yêu cầu rút tiền

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
---	----	--	------------------------------	-----------------------------	-----	---

M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 613	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị CASH	73x	3
Bắt đầu khối: Thông tin chung						
M	16 R	GENL				4
M	23 G		Function of the Message	Lấy giá trị là: REJT	4!c	5
M	98 A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	7
M	16 R	LINK				8
M	20 C	RELA	Report reference	Tham chiếu đến điện MT103 yêu cầu rút tiền (trường 20)	:4!c//16x	9
M	16S	LINK				10
M	70 D	REAS	Report reference	Lý do từ chối	:4!c//35x	11
M	16S	GENL				12
Kết thúc khối: Thông tin chung						

2.3. TVBT yêu cầu VSDC phong tỏa/giải tỏa chứng khoán trên tài khoản ký quỹ giao dịch phái sinh NĐT



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: TVBT thông báo cho VSDC về việc phong tỏa/giải tỏa tài sản ký quỹ là chứng khoán bằng điện MT524.

- Bước 2:

2.1: Nếu thành công, VSDC gửi điện MT508 xác nhận yêu cầu.

2.2: Nếu không thành công (cán bộ VSDC từ chối duyệt), VSDC gửi điện NAK/MT548 từ chối yêu cầu (NAK trong trường hợp sai cấu trúc điện, thiếu số dư...; MT548 trong trường hợp user VSDC từ chối duyệt giao dịch)

MT524 - Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa tài sản ký quỹ là chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Tham chiếu số hiệu yêu cầu gửi từ TVBT	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	NEWM: Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán CANC: Hủy yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	4!c	4!c	Nếu 23G = CANC Dùng để liên kết đến Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán trước đó	:4!c//16x	6
O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin giao dịch						
M	16R	INPOSD ET				9
M	95P	ACOW		Mã BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	10
M	97A	SAFE		Số tài khoản ký quỹ giao dịch	:4!c//35x	11

M	36 B	SETT	Quantity of financial instrument	Khối lượng Giá trị của qualifier :SETT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ :SETT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	12
M	35 B			Chứng khoán	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]	13
M	98 A	SETT		Ngày hạch toán	:4!c//8!n	14
M	70 E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	15
M	93 A	FROM	Balance	Loại giao dịch :FROM//AVAL, nộp :FROM//COLA, rút	:4!c//4!c	16
M	93 A	TOBA		:TOBA//COLA, nộp :TOBA//AVAL, rút	:4!c//4!c	17
M	16S	INPOSD ET				18
Kết thúc Block: Thông tin giao dịch						

MT508 - Xác nhận kết quả phong tỏa/giải tỏa tài sản ký quỹ là chứng khoán của NĐT

Bắt đầu Block: Thông tin chung

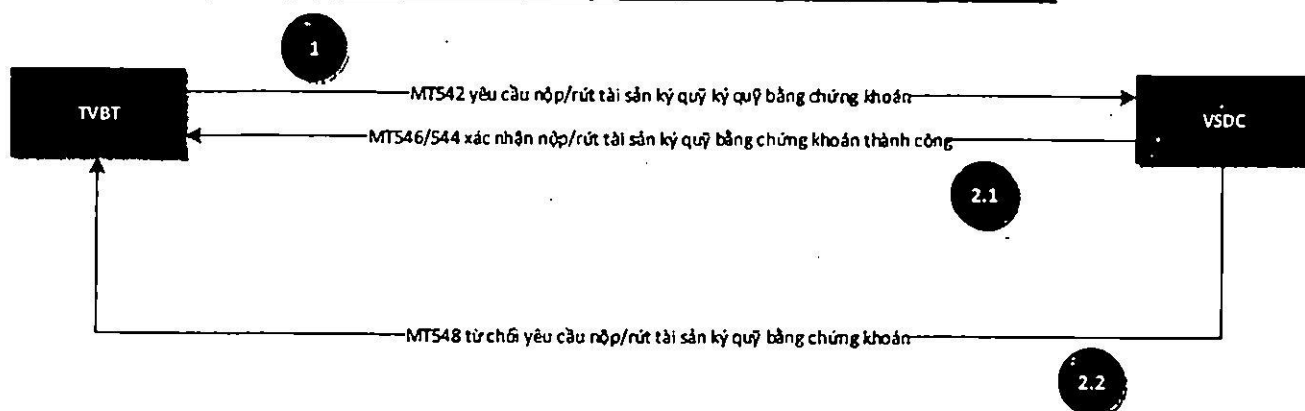
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị NEWM: Xác nhận CANC: Hủy xác nhận	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	13A	LINK		Lấy giá trị là :LINK//524 nếu 23G=NEWM	:4!c//3!c	6

				:LINK//508 nếu 23G=CANC		
M	20C	4!c		RELA: Tham chiếu đến Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán (23G=NEWM) PREV: Tham chiếu đến Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán (23G=CANC)	:4!c//16x	7
O	16S	LINK				8
M	16S	GENL				9
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin giao dịch						
M	16R	INPOSD ET				10
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2 !c[3!c]	11
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản NĐT/TVBT	:4!c//35x	12
M	36B	ESTT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	13
M	35B			Chứng khoán	[ISIN1!e12!c] [2!a/32x]	14
M	98A	SETT	Date	Ngày hạch toán	:4!c//8!n	15
O	70E	SPRO		Ghi chú		16
M	93A		Balance	Loại giao dịch :FROM//AVAL, phong tỏa :FROM//COLA, giải tỏa	:4!c//4!c	17
M	93A		Balance	:TOBA//COLA, phong tỏa :TOBA//AVAL, giải tỏa	:4!c//4!c	18

M	16S	INPOSD ET				19
Kết thúc Block: Thông tin giao dịch						

Status	Tag	Qualifier	Field Name	Description	Content	Number
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16 R	GENL				1
M	20 C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23 G	INST	Function of the Message		4!c	3
O	98 A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message	:4!c//8!n	4
M	16 R	LINK				5
O	13a	LINK	Number identification	Lấy giá trị :LINK//524.	:4!c//3!c	6
M	20 C	RELA	Reference	Tham chiếu đến Yêu cầu phong tỏa/giải tỏa chứng khoán	:4!c//16x	7
M	16S	LINK				8
M	16 R	STAT				9
M	25 D	IPRC	Status	Lấy giá trị :IPRC//REJT	:4!c//4!c	10
M	16 R	REAS				11
M	24 B	REJT	Reason	Lấy giá trị :REJT/NARR	:4!c//4!c	12
O	70 D	REAS		Nội dung từ chối	:4!c//6*35x	13
M	16S	REAS				14
M	16S	STAT				15
M	16S	GENL				16
Bắt đầu Block: Thông tin chung						

2.4. TVBT nộp ký quỹ/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán cho VSDC



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: TVBT gửi điện MT542 yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán. Yêu cầu này sẽ thực hiện chuyển khoản chứng khoán giữa hệ thống lưu ký và hệ thống phái sinh.
- Bước 2: Hệ thống VSDC kiểm tra và xử lý yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán:
 - Trường hợp chuyển thành công sẽ gửi điện MT546 (thông báo ghi giảm số dư)/MT544 (thông báo ghi tăng số dư) phục vụ xác nhận nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán thành công cụ thể như sau:
 - Đối với trường hợp nộp: MT546 thông báo giảm số dư tại hệ thống lưu ký, MT544 thông báo tăng số dư tại hệ thống phái sinh
 - Đối với trường hợp rút: MT546 thông báo giảm số dư tại hệ thống phái sinh, MT544 thông báo tăng số dư tại hệ thống lưu ký
 - Trường hợp không thực hiện được (sai cấu trúc điện, thiếu số dư...) sẽ gửi điện NAK từ chối yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán.

MT542 – Yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của TVBT (giá trị này là duy nhất)	:4!c//16x	2
M	23G	NEWM	Function of the Message	NEWM: Yêu cầu chuyển khoản	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo yêu cầu	:4!c//8!n	4

Bắt đầu Block: Thông tin thanh toán chi tiết						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị :SETR//COLI: Nộp :SETR//COLO: Rút	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO	Indicator	Lấy giá trị :STCO//DLWM	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRTY				23
M	95P	PSET	Place of settlement	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	24
M	16S	SETPRTY				25
M	16R	SETPRTY				26
M	95P	DEAG		BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	27
M	16S	SETPRTY				28
M	16R	SETPRTY				29
M	95P	REAG		Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	30
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản giao dịch cho ký quỹ	:4!c//35x	31
M	16S	SETPRTY				32
M	16S	SETDET				33
Kết thúc Block: Thông tin thanh toán chi tiết						

MT546 – Thông báo giảm số dư để xác nhận yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu của tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G	NEWM	Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3

O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
M	16R	LINK				5
O	13A	LINK		Lấy giá trị :LINK/542	:4!c//3!c	6
M	20C	RELA	Reference	Tham chiếu đến số hiệu yêu cầu chuyển khoản	:4!c//16x	7
M	16S	LINK				8
M	16S	GENL				9
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin chuyển khoản						
M	16R	TRADDET				10
M	98A	ESET	Date	Ngày hạch toán	:4!c//8!n	11
M	35B		Identification of the Financial Instrument	Chứng khoán	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]	12
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	13
M	16S	TRADDET				14
Kết thúc Block: Thông tin chuyển khoản						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản chuyển						
M	16R	FIAC				15
M	36B	SETT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	16
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	17

M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản giao dịch cho ký quỹ	:4!c//35x	18
M	16S	FIAC				19
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản chuyển						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản nhận						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị :SETR//COLI, nộp ký quỹ ban đầu :SETR//COLO, rút ký quỹ ban đầu	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO	Indicator	Lấy giá trị :STCO//DLWM	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRTY				23
M	95P	PSET	Party	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	24
O	20C	PROC	Reference		:4!c//16x	25
M	16S	SETPRTY				26
M	16R	SETPRTY				27
M	95P	REAG	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	28
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản giao dịch cho ký quỹ	:4!c//35x	29
M	16S	SETPRTY				30
M	16S	SETDET				31
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản nhận						

MT544 – Thông báo tăng số dư để xác nhận yêu cầu nộp/rút tài sản ký quỹ bằng chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1

M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date/	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
M	16R	LINK				5
O	13A	LINK		Lấy giá trị :LINK/542	:4!c//3!c	6
M	20C	RELA	Reference	Tham chiếu đến số hiệu yêu cầu chuyển khoản	:4!c//16x	7
M	16S	LINK				8
M	16S	GENL				9
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin giao dịch						
M	16R	TRADDE T				10
M	98A	ESET		Ngày hiệu lực	:4!c//8!n	11
M	35B			Chứng khoán	[ISIN1!e12!c] [2!a/32x]	12
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	13
M	16S	TRADDE T				14
Kết thúc Block: Thông tin giao dịch						
Bắt đầu Block: Thông tin chi tiết						
M	16R	FIAC				15
M	36B	ESTT	Quantity of financial instrument	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ, chứng khoán phái sinh :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	16
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT nhận chuyển khoản	:4!c//4!a2!a2!c [3c]	17

M	97A	SAFE		Tài khoản của nhà đầu tư nhận chuyển khoản	:4!c//35x	18
M	16S	FIAC				19
Kết thúc Block: Thông tin chi tiết						
Bắt đầu Block: Thanh toán chi tiết						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR		Lấy giá trị :SETR//COLI, nộp ký quỹ ban đầu :SETR//COLO, rút ký quỹ ban đầu	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO		Lấy giá trị là :STCO//DLWM	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRT Y				23
M	95P	PSET	Place of settlement	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c [3!c]	24
M	16S	SETPRT Y				21
M	16R	SETPRT Y				22
M	95P	DEAG		BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c [3c]	23
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản bên chuyển	:4!c//35x	24
M	16S	SETPRT Y				25
M	16S	SETDET		End of block SETDET		26
Kết thúc Block: Thanh toán chi tiết						

2.5. Phân bổ lãi tiền gửi tiền ký quỹ

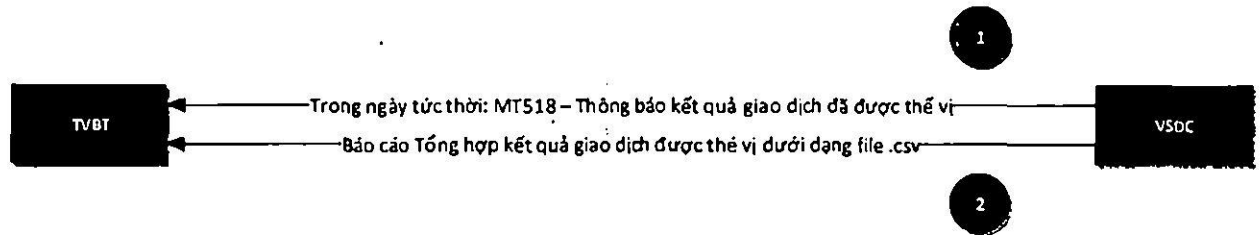
Lãi tiền gửi phát sinh trên Tài khoản tiền ký quỹ tự doanh/môi giới của TVBT (tài khoản BICCODE.P, BICCODE.C – đứng tên VSDC) sẽ được VIETINBANK tự động tính toán và hạch toán vào ngày cuối tháng. Lãi tiền gửi không được hạch toán vào số dư tài khoản ký quỹ tại VSDC tại ngày phân bổ lãi. Bảng kê tính lãi được gửi dưới dạng văn bản/view báo cáo nếu TVBT có kết nối hệ thống với VIETINBANK.

Sau đó, lãi sẽ được tự động chuyển về Tài khoản mà TVBT đã đăng ký với VIETINBANK (tài khoản BICCODE.R) vào ngày liền sau.

Trường hợp TVBT đang trong tình trạng mất khả năng thanh toán hoặc chấm dứt tư cách thành viên, việc xử lý khoản lãi phát sinh sẽ do VSDC quy định và thông báo cho VIETINBANK trước thời điểm phân bổ lãi.

3. Bù trừ và quản lý vị thế

3.1. VSDC thông báo kết quả giao dịch CKPS đã được thế vị cho TVBT



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: Sau khi nhà đầu tư giao dịch thành công trên Sở giao dịch, kết quả giao dịch được gửi tức thời cho VSDC để thế vị, sau khi thực hiện thế vị, VSDC sẽ gửi điện MT518 cho từng TVBT về kết quả giao dịch được thế vị. Nếu lệnh khớp của cùng một TVBT thì sẽ chỉ gửi 01 điện MT518 cho TVBT, thông tin bao gồm cả NĐT bên mua và NĐT bên bán;
- Bước 2: Cuối ngày, VSDC gửi báo cáo tổng hợp kết quả giao dịch đã được thế vị dưới dạng file .csv về cho TVBT

MT518 – Thông báo kết quả giao dịch đã được thế vị

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị NEWM: Thông báo thế vị mới CANC: Hủy thông báo thế vị trước đó	4!c	3
M	22F	TRTR	Indicator	Lấy giá trị là :TRTR/TRAD	:4!c//4!c	4
M	16R	LINK				5

M	20C	PREV	Reference	Số hiệu tham chiếu của MT518 cần hủy nếu 23G=CANC	:4!c//16x	6
M	16S	LINK				7
M	16R	LINK				8
M	20C	RELA	Reference	Số hiệu tham chiếu xử lý ở hệ thống VSDC (TRDnnnnnnnnn, 9 digit number)	:4!c//16x	9
M	16S	LINK				10
M	16R	LINK				11
M	20C	TRRF	Reference	Tham chiếu khớp lệnh tại exchange	:4!c//16x	12
M	16S	LINK				13
M	16S	GENL				14
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin xác nhận						
M	16R	CONFDE T				15
M	98C	TRAD		Thời điểm khớp lệnh	:4!c//8!n6!n	16
M	98A	SETT		Ngày hiệu lực	:4!c//8!n	17
M	90B	DEAL	Price	Giá khớp	:4!c//3!a15 d	18
O	19A	SETT	Amount	Giá trị khớp	:4!c//[N]3!a 15d	19
M	22H	BUSE	Indicator	BUYI for buyer, SELL for seller or CROF for crossing		20
M	22H	PAYM	Indicator	Lấy giá trị APMT		21
M	16R	CONFPR TY				22
M	95R	AFFM		Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//34x	23
M	16S	CONFPR TY				24

M	16R	CONFPR TY				25
M	95R	SELL		BICCODE của TVBT nếu TVBT là bên bán Trường hợp TVBT là bên mua thì giá trị của trường này là VSDCSVN06	:4!c//34x	26
M	16S	CONFPR TY				27
M	16R	CONFPR TY				28
M	95R	BUYR		BICCODE của TVBT nếu TVBT là bên mua Trường hợp TVBT là bên bán thì giá trị của trường này là VSDCSVN06	:4!c//34x	29
M	16S	CONFPR TY				30
M	36B	CONF		Khối lượng CONF//UNIT	:4!c//4!c/15 d	31
M	35B			Chứng khoán	[ISIN1!e12 !c] [/2!a/32x]	32
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35 x	33
M	16S	CONFDE T				34
Kết thúc Block: Thông tin xác nhận						
Bắt đầu Block: Thông tin thanh toán						
M	16R	SETDET				35
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị :SETR//TRAD	:4!c//4!c	36
Bắt đầu Block: Thông tin đối tác thanh toán						
M	16R	SETPRT Y				37
M	95P	DEAG	Party	BICCODE bên bán		38
M	20C	PROC	Reference	Số hiệu lệnh bên bán		39

MT598 – Thông báo tổng hợp kết quả giao dịch được thể vị cuối ngày

Segment	Tag	Qualifier	Field Number	Description	Format	No.
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 621	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị TRADE	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	23G	NEWM	Function of the message	Lấy giá trị NEWM	4!c	5
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo báo cáo	:4!c//8!n	6
M	16R	LINK				7
M	20C	PREV	Report Reference	Tên file .csv báo cáo	:4!c//16x	8
M	16S	LINK				9
M	20C	STAT	Report Reference	The name of the report, date-name-recipient [Date]_[Report name]_[Recipient] e.g: • 20160323_Trade_001	:4!c//35x	10
M	16S	GENL				11
Kết thúc Block: Thông tin chung						

Cấu trúc file .csv kết quả khớp lệnh:

Các thông tin thể hiện trên file gồm: Mã CKPS, Số TKGD cho mục đích kỹ quỹ, số hiệu TVBT, thời điểm khớp lệnh, giá khớp lệnh, số lượng.

Cấu trúc file .par gửi kèm với báo cáo kết quả khớp lệnh như sau:

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
SwiftTime	DateTime	<!SWIFTTIME> Thời điểm xử lý tại VSDC Gateway ISO 8601 datetime format <YYYY-MM-DD>T<HH:MM> Ví dụ: 2007-04-05T14:30
NonRep	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
DeliveryTime	DateTime	<!DELIVERTIME> Thời điểm truyền dữ liệu ISO 8601 datetime format
MsgId	String	<!STPREFSEQID> Số sequence do VSDCGateway tạo ra string length <= 40
Creationtime	DateTime	<\$FILECREATETIME> Thời điểm tạo tệp tin dữ liệu (thuộc tính của file dữ liệu) ISO 8601 datetime format
PDIndication	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
Requestor	UserDN	Thông tin bên gửi (BICCODE của VSDC, lấy giá trị là VSDCSVN06) o=<\$VSDCBICCODE>, o=swift string length <= 100
Responder	UserDN	Thông tin bên nhận (BICCODE của TVBT) o=<\$MEMBERBICCODE>, o=swift string length <= 100
Service	String	Mặc định là: swift.corp.fast string length <= 30

Tên	Loại dữ liệu	Chú thích - Độ dài hoặc giá trị cho phép
RequestType	String	Mặc định là camt.xxx.fisp.rep ¹ string length <= 30
Priority	String	Mặc định là Normal string matches "Normal" "Urgent"
RequestRef	String	<\$REFREQID> Là giá trị trường 20 của điện MT598 kèm theo string length <= 30
TransferRef	String	<\$EVENTCODE> Lấy giá trị là TRADE string length <= 30
TransferDescription	String	<\$EVENTNAME> string matches any* length <= 256 octet
TransferInfo	String	<\$MEMBERBICCODE>.TRADE.<\$SYSDATE> <\$RequestRef> string matches US ASCII* length <= 256
PossibleDuplicate	Boolean	Mặc định là TRUE string matches "FALSE" "TRUE"
OrigTransferRef	String	Số reference của hệ thống VSDC gửi ra string length <= 30
AckIndicator	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
LogicalName		Tên tệp tin dữ liệu Sw filename
FileDescription	String	Mô tả thêm (có thể không dùng) string matches any* length <= 256 octet
FileInfo	String	Mặc định: SwCompression=None string matches US ASCII* length <= 256
Size		<\$FILESIZE> Kích thước tệp tin dữ liệu integer <= 0

¹ Financial institution specific

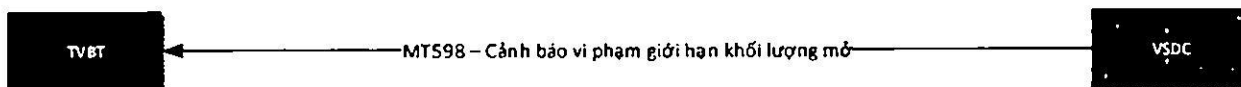
M	16 R	GENL				4
M	70 D	EXPO	Account Status	Y = Tài khoản hoạt động bình thường X = Dừng giao dịch tài khoản S = Dừng giao dịch mã chứng khoán 1 = Cảnh báo mức 1 2 = Cảnh báo mức 2	4!c//1!c	5
O	97 A	SAFE	Account	Tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	6
O	35 B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN1!e12!c] [2!a/32x]	7
Bắt đầu Block: BCOL						
O	16R	BCOL				8
M	19B	TEXA	Amount	Giá trị ký quỹ yêu cầu	4!c//3!a15d	9
M	19B	MRKT	Amount	Tổng giá trị tài sản ký quỹ	4!c//3!a15d	10
M	19B	RECA	Amount	Giá trị tài sản lý quỹ hợp lệ	4!c//3!a15d	11
O	16S	BCOL				12
Kết thúc Block: BCOL						
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày lập điện	:4!c//8!n	13
M	16S	GENL				14
Kết thúc Block: Thông tin chung						

3.3. Cảnh báo vi phạm giới hạn vị thế



O	16R	SCOL		<i>Chỉ áp dụng cho 77E =POSITION</i>		8
M	36B	SECV		UNIT = Số lượng vị thể hiện tại	4!c//4!c/15d	9
M	36B	COLL		UNIT = Số lượng vị thể tối đa	4!c//4!c/15d	10
O	16S	SCOL				11
Kết thúc Block: BCOL/SCOL						
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày lập điện	4!c//8!n	12
M	16S	GENL				13
Kết thúc Block: Thông tin chung						

3.4. Cảnh báo vi phạm giới hạn khối lượng mở



VSDC thiết lập và giám sát tỷ lệ giữa số vị thể TVBT nắm giữ tổng khối lượng mở (OI) của toàn thị trường. Hệ thống VSDC sẽ gửi cảnh báo tức thời ngay khi số lượng vị thể của bất kỳ tài khoản nào vi phạm giới hạn về khối lượng mở. Hệ thống của VSDC sẽ tự động gửi cảnh báo bằng điện MT598 khi tỷ lệ nói trên vi phạm giới hạn, ngưỡng cảnh báo do VSDC thiết lập.

MT598 – Cảnh báo vi phạm giới hạn khối lượng mở

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub- Message Type	Lấy giá trị 699	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: LIMIT	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16 R	GENL				4
M	70 D	EXPO	Account Status	Y = Tài khoản hoạt động bình thường	4!c//1!c	5

				X = Dừng giao dịch tài khoản S = Dừng giao dịch mã chứng khoán 1 = Cảnh báo mức 1 2 = Cảnh báo mức 2		
O	97 A	SAFE	Account	Tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	6
O	35 B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN1!e12!c] [2!a/32x]	7
Bắt đầu Block: SCOL						
O	16 R	SCOL		<i>Chỉ áp dụng cho 77E =LIMIT</i>		8
M	36 B	SECV		UNIT = Số lượng vị thế hiện tại	4!c//4!c/15d	9
M	36 B	COLL		UNIT = Số lượng vị thế tối đa	4!c//4!c/15d	10
O	16S	SCOL				11
Kết thúc Block:SCOL						
M	98 A	PREP	Preparation Date	Ngày lập điện	:4!c//8!n	12
M	16S	GENL				13
Kết thúc Block: Thông tin chung						

3.5. Cảnh báo phong tỏa tài khoản

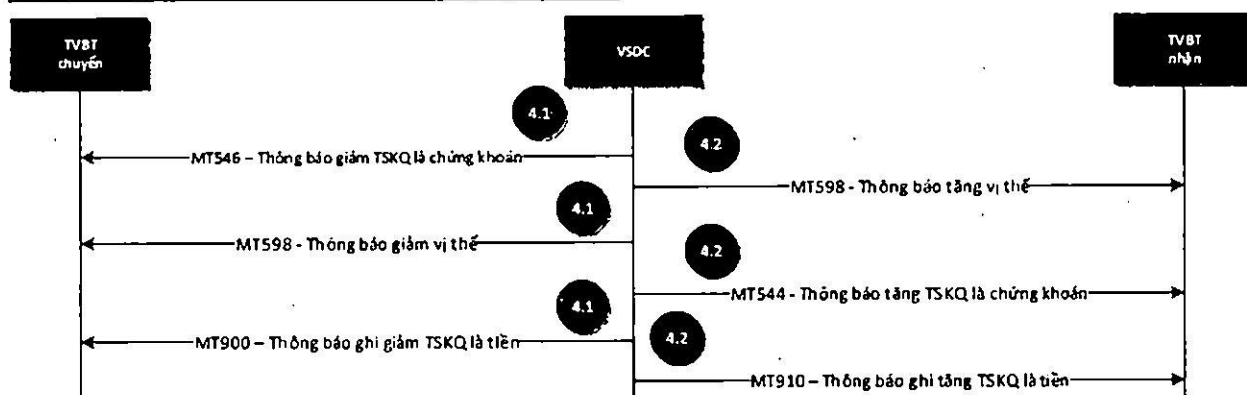


MT598 – Cảnh báo phong tỏa tài khoản

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 699	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị:BLOCK	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	70D	EXPO	Account Status	Y = Tài khoản hoạt động bình thường X = Dừng giao dịch tài khoản	4!c//1!c	5

				S = Dừng giao dịch mã chứng khoán 1 = Cảnh báo mức 1 2 = Cảnh báo mức 2		
O	97A	SAFE	Account	Tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	6
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày lập điện	:4!c//8!n	7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						

3.6. Chuyển khoản tất toán vị thế, ký quỹ



Trình tự thực hiện:

Trong trường hợp nhà đầu tư thay đổi TVBT, thứ tự các bước thực hiện:

- Bước 1: Đăng ký thông tin tài khoản giao dịch cho mục đích ký quỹ và giao dịch mới tại TVBT mới (nếu chưa có)
- Bước 2: TVBT bên chuyển gửi hồ sơ lên VSDC yêu cầu chuyển khoản tất toán vị thế và tài sản ký quỹ từ TVBT bên chuyển sang TVBT bên nhận
- Bước 3: Cán bộ VSDC thực hiện
 - Chuyển khoản vị thế của nhà đầu tư từ tài khoản giao dịch CKPS tại TVBT bên chuyển sang tài khoản giao dịch CKPS tại TVBT bên nhận;
 - Chuyển khoản chứng khoán và thông báo cho Ngân hàng thanh toán chuyển khoản tiền ký quỹ của nhà đầu tư từ tài khoản tiền ký quỹ của TVBT bên chuyển (đứng tên VSDC) sang tài khoản tiền ký quỹ của TVBT bên nhận (đứng tên VSDC) mở tại NHHT.

(Bước 1, 2, 3 không phát sinh điện giữa VSDC và TVBT)

- Bước 4: VSDC gửi điện dưới đây cho TVBT liên quan thông báo về:

4.1. MT546 đồng thời với MT900 cho TVBT bên chuyển việc ghi giảm tài sản ký quỹ của nhà đầu tư.

- MT598 cho TVBT bên chuyển về việc ghi giảm vị thế trên tài khoản của nhà đầu tư

4.2. MT544 đồng thời với MT910 cho TVBT bên nhận việc ghi tăng tài sản ký quỹ của nhà đầu tư.

- MT598 cho TVBT bên nhận về việc ghi tăng vị thế trên tài khoản của nhà đầu tư

MT546 – Thông báo giảm tài sản ký quỹ là chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu của tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G	NEWM	Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	RELA	Relation	Số tham chiếu hệ thống phái sinh	:4!c//16x	6
O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin chuyển khoản						
M	16R	TRADD ET				9
M	98A	ESET	Date	Ngày hạch toán	:4!c//8!n	10
M	35B		Identification of the Financial Instrument	Chứng khoán (chứng khoán phái sinh và chứng khoán làm tài sản ký quỹ)	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]	11
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	12
M	16S	TRADD ET				13

Kết thúc Block: Thông tin chuyển khoản						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản chuyển						
M	16R	FIAC				14
M	36B	ESTT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ, chứng khoán phái sinh :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	15
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT bên chuyển	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	16
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản bên chuyển	:4!c//35x	17
M	16S	FIAC				18
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản chuyển						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản nhận						
M	16R	SETDET				19
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị là :SETR//COLO	:4!c//4!c	20
M	22F	STCO		Lấy giá trị là :STCO//DRAW	:4!c//4!c	21
M	16R	SETPRT Y				22
M	95P	PSET	Party	Lấy giá trị là: VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	23
O	20C	PROC	Reference		:4!c//16x	24
M	16S	SETPRT Y				25
M	16R	SETPRT Y				26
M	95P	REAG	Party	BICCODE của TVBT bên nhận	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	27
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản bên nhận	:4!c//35x	28
M	16S	SETPRT Y				29

M	16S	SETDET				30
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản nhận						

MT544 - Thông báo tăng tài sản ký quỹ là chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date/	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	RELA	Relation	Số tham chiếu hệ thống phải sinh	:4!c//16x	6
O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin giao dịch						
M	16R	TRADD ET				9
M	98A	ESET		Ngày hiệu lực	:4!c//8!n	10
M	35B			Chứng khoán	[ISIN1!e12! c] [/2!a/32x]	11
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	12
M	16S	TRADD ET				13
Kết thúc Block: Thông tin giao dịch						
Bắt đầu Block: Thông tin chi tiết						
M	16R	FIAC				14

MT900 – Thông báo ghi giảm tài sản ký quỹ là tiền của bên chuyển

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu của ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng ghi giảm Là tài khoản BICCODE.C	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	AT//Số tài khoản ký quỹ của NĐT chuyển/Số tài khoản ký quỹ của NĐT nhận	6*35x	6

MT910 – Thông báo ghi tăng tài sản ký quỹ là tiền bên nhận

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu của ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản tại ngân hàng được ghi tăng số dư Là tài khoản BICCODE.C	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5

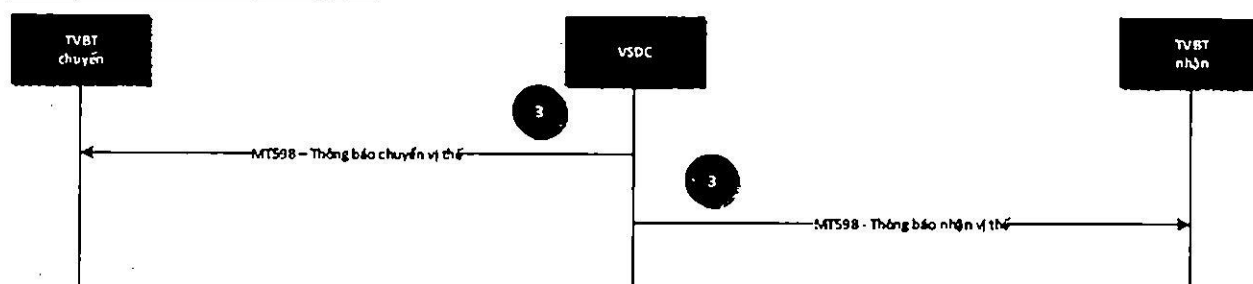
M	72		Sender to Receiver information	AT//Số tài khoản ký quỹ của NĐT chuyển/Số tài khoản ký quỹ của NĐT nhận	6*35x	6
---	----	--	--------------------------------	---	-------	---

MT598 – Thông báo tăng/giảm vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 631	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: - GIVEUP - TAKEUP	73x	3
M	16R	GENL				4
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	5
M	35B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]	6
M	70E	SPRO	Position quantities	Tối đa 02 dòng. 4!c thứ hai lấy một trong các giá trị sau LFUT=long, SFUT=short Ví dụ :70E://SPRO/LFUT/40 SFUT/30	:4!c//4*35x	7
M	90B	DEAL	Average price	4!c thứ hai lấy một trong các giá trị sau LFUT=long, SFUT=short Ví dụ DEAL//LFUT/VND/12 3 DEAL//SFUT/VND/12 3 Ghi chú: trường hợp không có long hoặc short thì giá sẽ là 0 VD DEAL//SFUT/VND/0	4!c//4!c/3!a/15d	8

O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày xác nhận (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	9
O	16R	LINK				10
M	20C	RELA		Link đến trường 20 của điện yêu cầu bù trừ vị thế	:4!c//16x	11
O	16S	LINK				12
M	16S	GENL				13

3.7. Chuyển khoản vị thế



Trình tự thực hiện:

Trong trường hợp nhà đầu tư có nhiều tài khoản giao dịch cho mục đích ký quỹ tại nhiều TVBT khác nhau và có nhu cầu chuyển khoản vị thế giữa các tài khoản này thì thực hiện theo trình tự sau:

- Bước 1: TVBT lập hồ sơ yêu cầu thực hiện chuyển khoản vị thế gửi lên VSDC
- Bước 2: Cán bộ VSDC thực hiện chuyển khoản vị thế giữa hai tài khoản giao dịch CKPS trên hệ thống của VSDC

(Bước 1, 2 không phát sinh điện giữa VSDC và TVBT)

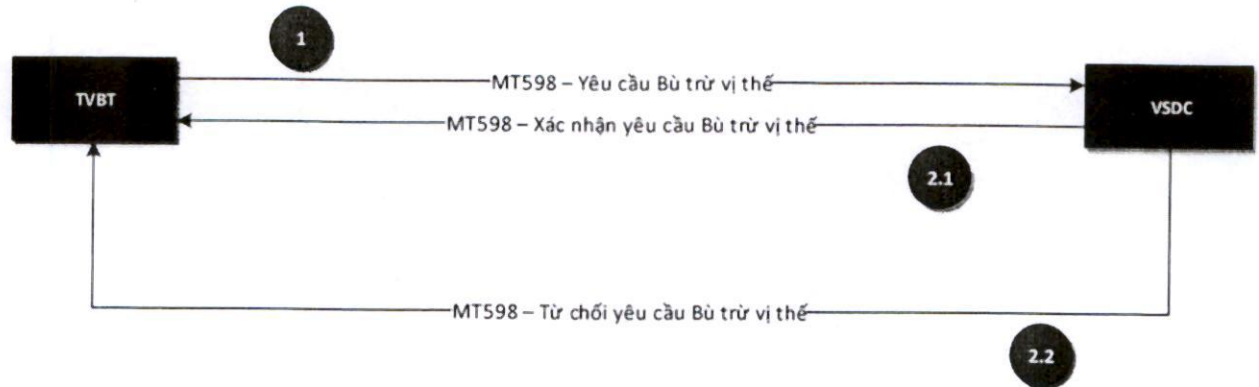
- Bước 3: Sau khi thực hiện chuyển khoản, VSDC sẽ gửi điện dưới đây cho TVBT liên quan thông báo về:
 - MT598 cho TVBT bên chuyển về việc ghi giảm vị thế trên tài khoản của nhà đầu tư
 - MT598 cho TVBT bên nhận về việc ghi tăng vị thế trên tài khoản của nhà đầu tư

MT598 – Thông báo tăng/giảm vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
---	----	--	------------------------------	-----------------------------	-----	---

Field No.	Field Name	Field Data	Field Description	Field Length	Field Type
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 631	3!n
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: GIVEUP TAKEUP	73x
M	16R	GENL			4
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x
M	35B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]
M	70E	SPRO	Position quantities	Tối đa 02 dòng. 4!c thứ hai lấy một trong các giá trị sau LFUT=long, SFUT=short Ví dụ :70E://SPRO/LFUT/40 SFUT/30	:4!c//4*35x
M	90B	DEAL	Average price	4!c thứ hai lấy một trong các giá trị sau LFUT=long, SFUT=short Ví dụ DEAL//LFUT/VND/12 3 DEAL//SFUT/VND/12 3 Ghi chú: trường hợp không có long hoặc short thì giá sẽ là 0 VD DEAL//SFUT/VND/0	4!c//4!c/3!a/15d
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày xác nhận (YYYYMMDD)	:4!c//8!n
O	16R	LINK			10
M	20C	RELA		Link đến trường 20 của điện yêu cầu bù trừ vị thế	:4!c//16x
O	16S	LINK			12
M	16S	GENL			13

3.8. Bù trừ vị thế trên tài khoản tổng hợp (Omnibus account)



Trình tự thực hiện:

Trong trường hợp nhà đầu tư được phép mở tài khoản tổng hợp (omnibus account), các vị thế mua bán của cùng một sản phẩm chứng khoán phái sinh có cùng tháng đáo hạn vẫn được duy trì trên tài khoản giao dịch CKPS. Khi có nhu cầu đóng bớt vị thế, TVBT có thể yêu cầu VSDC bù trừ vị thế trên tài khoản tổng hợp này.

Trình tự thực hiện:

- Bước 1; TVBT gửi điện M598 yêu cầu bù trừ (chỉ định các cặp vị thế sẽ được bù trừ)
- Bước 2: Cán bộ VSDC kiểm tra xử lý và gửi trả kết quả:
 - 2.1. Xác nhận yêu cầu bù trừ vị thế bằng điện MT598 (giá trị trường 12 là 631)
 - 2.2. Từ chối xử lý bằng điện MT598 (giá trị của trường 12 là 633)

MT598 – Yêu cầu bù trừ vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của TVBT	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 630	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: REDUCE	73x	3
M	16R	GENL				4
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	5
M	35B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN!e12!c] [/2!a/32x]	6
M	36B	SETT	Quantity of financial instrument	Khối lượng vị thế yêu cầu bù trừ	:4!c//15d	7

M	16S	GENL				8
---	-----	------	--	--	--	---

MT598 – Xác nhận yêu cầu bù trừ vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 631	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: • REDUCE	73x	3
M	16R	GENL				4
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ của NĐT	:4!c//35x	5
M	35B			Mã chứng khoán phái sinh	[ISIN1!e12!c] [/2!a/32x]	6
M	36B	SETT	Quantity of financial instrument	Khối lượng vị thế yêu cầu bù trừ	:4!c//15d	7
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày xác nhận (YYYYMMDD)	:4!c//8!n	8
M	16R	LINK				9
M	20C	RELA		Link đến trường 20 của điện yêu cầu bù trừ vị thế	:4!c//16x	10
M	16S	LINK				11
M	16S	GENL				12

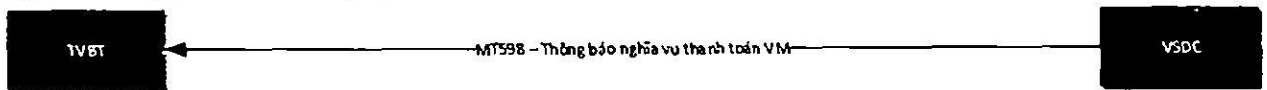
MT598 – Từ chối yêu cầu bù trừ vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 633	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị: • REDUCE	73x	3
M	16R	GENL				4
M	23G	REJT	Function of the message	Lấy giá trị REJT	4!c	5
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo	:4!c//8!n	6
M	16R	LINK				7

M	20C	RELA		Link đến trường 20 của điện yêu cầu bù trừ vị thế	:4!c//16x	8
M	16S	LINK				9
M	20C	STAT	Report Reference	Lý do từ chối - Vị thế không có - Khối lượng vị thế nhỏ hơn khối lượng yêu cầu bù trừ	:4!c//35x	10
M	16S	GENL				11

4. Thanh toán lãi/lỗ vị thế

4.1. VSDC thông báo nghĩa vụ thanh toán lãi/lỗ vị thế (VM) cho TVBT



Cuối ngày, VSDC tính toán nghĩa vụ thanh toán hàng ngày đối với từng tài khoản NĐT/TVBT; và gửi điện MT598 kèm file csv thông báo nghĩa vụ thanh toán hàng ngày cho TVBT.

MT598 – Thông báo nghĩa vụ thanh toán lãi/lỗ vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 621	3!n	2
M	77E		Proprietary Message	Lấy giá trị SETTLEMENT	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				4
M	23G	NEWM	Function of the message	Lấy giá trị NEWM	4!c	5
M	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo báo cáo	:4!c//8!n	6
M	16R	LINK				7
M	20C	PREV	Report Reference	Tên file .csv báo cáo	:4!c//16x	8
M	16S	LINK				9
M	20C	STAT	Report Reference	The name of the report, date-name-recipient	:4!c//35x	10

				[Date]_[Report name]_[Recipient] e.g: • 20160323_Settl ement_001		
M	16S	GENL				11
Kết thúc Block: Thông tin chung						

Cấu trúc file .csv thông báo nghĩa vụ thanh toán hàng ngày bao gồm các thông tin chi tiết:

- Tài khoản giao dịch cho ký quỹ của NĐT/TVBT
- Giá trị lỗ/lãi ròng tương ứng từng tài khoản.
- Giá trị lỗ/lãi ròng theo TVBT

Cấu trúc file .par gửi kèm với thông báo nghĩa vụ thanh toán hàng ngày như sau:

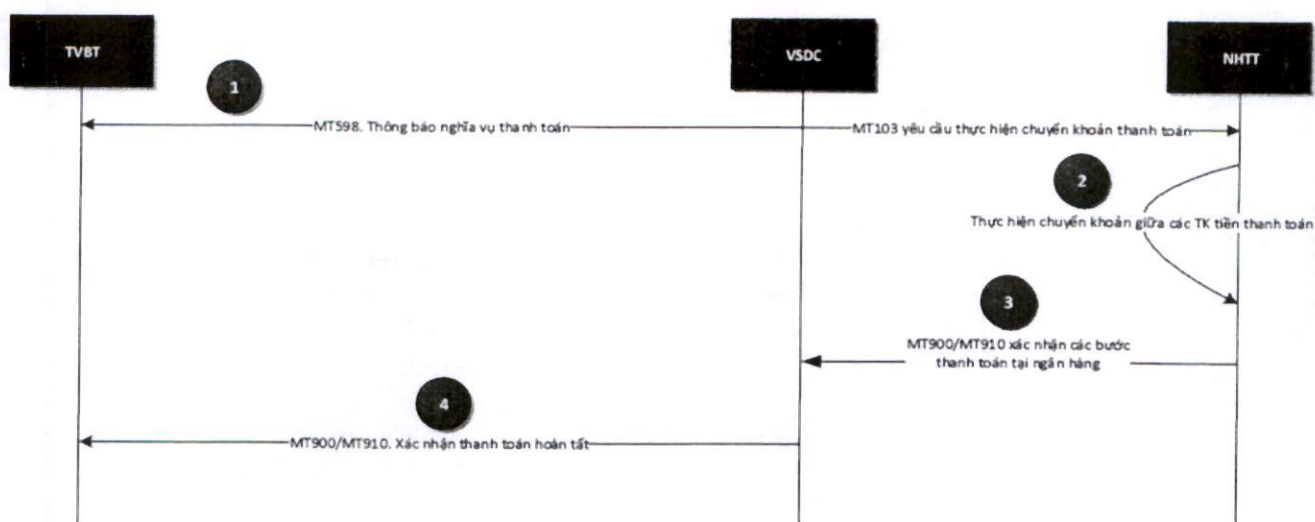
Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
SwiftTime	DateTime	<!SWIFTTIME> Thời điểm xử lý tại VSDC Gateway ISO 8601 datetime format <YYYY-MM-DD>T<HH:MM> Ví dụ: 2007-04-05T14:30
NonRep	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
DeliveryTime	DateTime	<!DELIVERTIME> Thời điểm truyền dữ liệu ISO 8601 datetime format
MsgId	String	<!STPREFSEQID> Số sequence do VSDCGateway tạo ra string length <= 40
Creationtime	DateTime	<\$FILECREATETIME> Thời điểm tạo tệp tin dữ liệu (thuộc tính của file dữ liệu) ISO 8601 datetime format
PDIndication	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
Requestor	UserDN	Thông tin bên gửi (BICCODE của VSDC, lấy giá trị là VSDCSVN06) o=<\$VSDCBICCODE>, o=swift string length <= 100
Responder	UserDN	Thông tin bên nhận (BICCODE của TVBT) o=<\$MEMBERBICCODE>, o=swift string length <= 100
Service	String	Mặc định là: swift.corp.fast string length <= 30
RequestType	String	Mặc định là camt.xxx.fisp.rep ² string length <= 30
Priority	String	Mặc định là Normal string matches "Normal" "Urgent"
RequestRef	String	<\$REFREQID> Là giá trị trường 20 của điện MT598 kèm theo string length <= 30
TransferRef	String	<\$EVENTCODE> Lấy giá trị là SETTLEMENT string length <= 30
TransferDescription	String	<\$EVENTNAME> string matches any* length <= 256 octet
TransferInfo	String	<\$MEMBERBICCODE>.SETTLEMENT.<\$SYSDATE>.<\$RequestRef> string matches US ASCII* length <= 256
PossibleDuplicate	Boolean	Mặc định là TRUE string matches "FALSE" "TRUE"
OrigTransferRef	String	Số reference của hệ thống VSDC gửi ra string length <= 30
AckIndicator	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"

² Financial institution specific

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
LogicalName		Tên tệp tin dữ liệu Sw filename
FileDescription	String	Mô tả thêm (có thể không dùng) string matches any* length <= 256 octet
FileInfo	String	Mặc định: SwCompression=None string matches US ASCII* length <= 256
Size		<\$FILESIZE> Kích thước tệp tin dữ liệu integer <= 0
SNLId	String	string length <= 30
SNLEP	String	string length <= 15
AckResponder	UserDN	<Không dùng> string length <= 100
AckRequestType	String	<Không dùng> string length <= 30
DigestAlgorithm	String	<Không dùng> string matches "SHA-1" "SHA-256"
DigestValue	String	<Không dùng> string length <= 50

4.2. Thực hiện thanh toán lãi/lỗ vi thể



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: Cuối ngày giao dịch (ngày T):
VSDC gửi điện MT598 cho TVBT (đồng thời gửi điện MT103 thông báo thực hiện thanh toán cho từng TVBT cho VIETINBANK) *Thông báo nghĩa vụ thanh toán hàng ngày – chi tiết mục 4.1*
- Bước 2: Ngày T+1, VIETINBANK sẽ thực hiện chuyển khoản thanh toán:
 - Từ TK tiền thanh toán TVBT bên trả → TK tiền thanh toán VSDC
 - TK tiền thanh toán VSDC → TK tiền thanh toán TVBT bên nhận
 - TK tiền thanh toán TVBT bên nhận → TK tiền gửi TVBT đã đăng ký với NHTT
- Bước 3: VIETINBANK gửi các cặp điện MT900/MT910 tương ứng từng bước chuyển khoản cho VSDC
- Bước 4: VSDC gửi điện MT900/MT910 xác nhận hoàn tất thanh toán với TVBT lãi/lỗ

MT910 – Thông báo TVBT lỗi đã nộp tiền

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1

M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu tại ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng thanh toán VM Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32 A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52 A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị: CRED	35x	6

MT900 – Thông báo cắt tiền từ TK tiền thanh toán TVBT lỗi

M	20		Transaction Reference Number	Transaction Reference Number	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu tại ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng thanh toán VM Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32 A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52 A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị: SETL	35x	6

MT910 – Thông báo chuyển tiền vào TK tiền thanh toán TVBT lãi (có thể được thay đổi)

--	--	--	--	--	--	--

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu tại ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng thanh toán VM Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị: SETL	73x	6

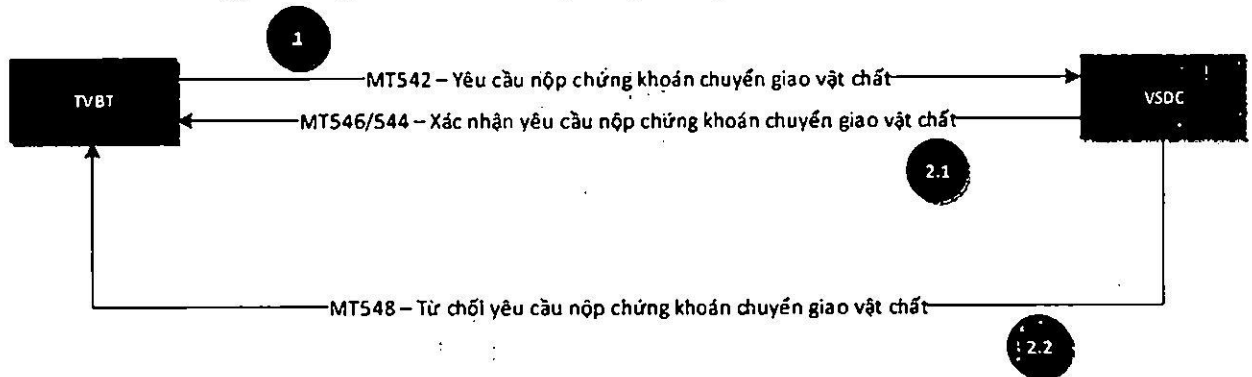
MT900- Thông báo cắt tiền trên TK tiền thanh toán TVBT lãi

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VIETINBANK	16x	1
M	21		Related Reference	Trùng với trường 20	16x	2
M	25		Account Identification	Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị PAYMENT	6*35x	6

5. Thanh toán đáo hạn

5.1. Thanh toán đáo hạn bằng chuyển giao vật chất

5.1.1. TVBT nộp chứng khoán để chuyển giao vật chất



Trình tự thực hiện:

Để thực hiện nộp chứng khoán để chuyển giao vật chất trong trường hợp TVBT nắm giữ vị thế bán, TVBT thực hiện các bước sau:

- Bước 1: TVBT gửi điện MT542 yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất
- Bước 2: Hệ thống VSDC kiểm tra và xử lý yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất:
 - 2.1. Trường hợp chuyển thành công sẽ gửi điện MT546/544 xác nhận yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất
 - 2.2. Trường hợp không thực hiện được sẽ gửi điện MT548 từ chối yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất

Trường hợp nhà đầu tư bên bán mất khả năng thanh toán chuyển giao trái phiếu, TVBT thực hiện vay chứng khoán qua hệ thống SBL. Chứng khoán vay được hạch toán vào tài khoản phong tỏa ký quỹ tự doanh đứng tên TVBT. VSDC thực hiện giao dịch chuyển khoản số lượng trái phiếu thiếu từ tài khoản phong tỏa ký quỹ tự doanh sang tài khoản tài khoản ký quỹ tại VSDC của nhà đầu tư mất khả năng thanh toán. Sau khi hạch toán, hệ thống VSDC gửi điện MT546 –Xác nhận yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất

MT542 –Yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của TVBT (giá trị này là duy nhất)	:4!c//16x	2

M	23G	NEWM	Function of the Message	NEWM: Yêu cầu chuyển khoản	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo yêu cầu	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	PCTI		Tham chiếu tới mã hợp đồng chuyển giao vật chất Bắt buộc phải có cho trường hợp giá trị của 22F là :STCO//EXER		6
O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8

Kết thúc Block: Thông tin chung

Bắt đầu Block: Chuyển khoản chi tiết

M	16R	TRADD ET				6
M	98A	SETT	Date	Ngày giao dịch	:4!c//8!n	7
M	35B		Identification of the Financial Instrument	Chứng khoán	[ISIN1!e1 2!c] [/2!a/32x]	8
O	16R	FIA				9
M	12A	4!c	Type of Financial Instrument	Lấy giá trị :CLAS//NORM/1	:4!c//4!c/1! n	10
O	16S	FIA				11
O	70E	SPRO	Narrative	Ghi chú	:4!c//4*35 x	12
M	16S	TRADD ET				13

Kết thúc Block: Chuyển khoản chi tiết

Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản chuyển

M	16R	FIAC				14
M	36B	SETT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier	:4!c//4!c/1 5d	15

				:SETT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ :SETT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu		
O	70D	DENC	Narrative	Ghi chú	:4!c//6*35x	16
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	17
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản của NĐT	:4!c//35x	18
M	16S	FIAC				19
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản chuyển						
Bắt đầu Block: Thông tin thanh toán chi tiết						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị :SETR//OWNE	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO	Indicator	Lấy giá trị :STCO//EXER: Nộp	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRTY				23
M	95P	PSET	Place of settlement	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	24
M	16S	SETPRTY				25
M	16R	SETPRTY				26
M	95P	DEAG		BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	27
M	16S	SETPRTY				28
M	16R	SETPRTY				29
M	95P	REAG		Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	30
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản của NĐT	:4!c//35x	31
M	16S	SETPRTY				32

M	16R	FIAC				15
M	36B	ESTT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	16
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	17
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ phái sinh của NĐT	:4!c//35x	18
M	16S	FIAC				19
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản chuyển						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản nhận						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị :SETR//OWNE	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO	Indicator	Lấy giá trị :STCO//EXER: Nộp :STCO//SPDL: Sử dụng khi VSDC thực hiện chuyển khoản từ tài khoản phong tỏa của tự doanh TVBT cho NĐT chuyển giao vật chất.	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRTY				23
M	95P	PSET	Party	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	24
O	20C	PROC	Reference		:4!c//16x	25
M	16S	SETPRTY				26
M	16R	SETPRTY				27
M	95P	REAG	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	28
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản ký quỹ phái sinh của NĐT	:4!c//35x	29
M	16S	SETPRTY				30

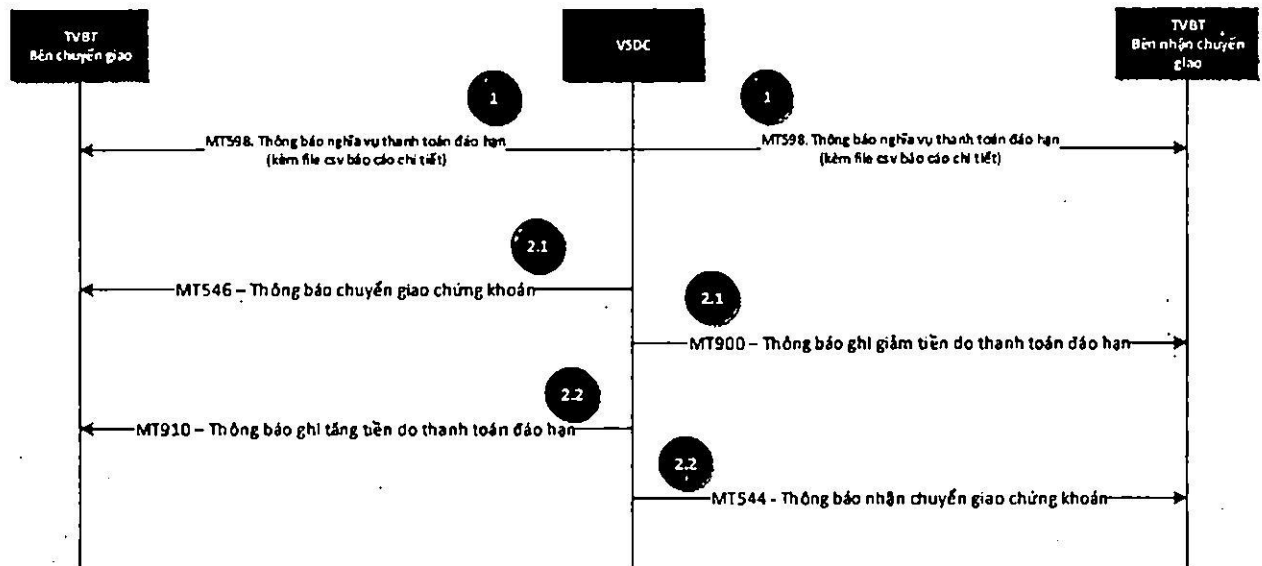
M	16R	FIAC				15
M	36B	ESTT	Quantity of financial instrument	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ, chứng khoán phái sinh :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15 d	16
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a 2!c[3c]	17
M	97A	SAFE		Tài khoản của nhà đầu tư	:4!c//35x	18
M	16S	FIAC				19
Kết thúc Block: Thông tin chi tiết						
Bắt đầu Block: Thanh toán chi tiết						
M	16R	SETDET				20
M	22F	SETR		Lấy giá trị :SETR//OWNE	:4!c//4!c	21
M	22F	STCO		Lấy giá trị :STCO//EXER: Nộp	:4!c//4!c	22
M	16R	SETPRTY				23
M	95P	PSET	Place of settlement	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a 2!c[3!c]	24
M	16S	SETPRTY				21
M	16R	SETPRTY				22
M	95P	DEAG		BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a 2!c[3c]	23
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản bên chuyển	:4!c//35x	24
M	16S	SETPRTY				25
M	16S	SETDET		End of block SETDET		26
Kết thúc Block: Thanh toán chi tiết						

MT548 – Từ chối yêu cầu nộp chứng khoán chuyển giao vật chất



Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G	INST	Function of the Message		4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo message	:4!c//8!n	4
M	16R	LINK				5
O	13A	LINK	Number identification	Lấy giá trị :LINK//542	:4!c//3!c	6
M	20C	RELA	Reference	Số hiệu tham chiếu của yêu cầu chuyển khoản	:4!c//16x	7
M	16S	LINK				8
M	16R	STAT				9
M	25D	IPRC	Status	Lấy giá trị :IPRC//REJT	:4!c//4!c	10
M	16R	REAS				11
M	24B	REJT	Reason	Lấy giá trị :REJT/NARR	:4!c//4!c	12
O	70D	REAS		Nội dung từ chối	:4!c//6*35x	13
M	16S	REAS				14
M	16S	STAT				15
M	16S	GENL				16
Kết thúc Block: Thông tin chung						

5.1.2 Thanh toán bằng chuyển giao vật chất



Đối với hình thức chuyển giao vật chất, tại chiều ngày E+2 VSDC sẽ gửi thông báo cho TVBT bên mua số tiền phải thanh toán dựa trên kết quả phân bổ ngẫu nhiên trái phiếu chuyển giao do TVBT bên bán đăng ký và/hoặc trái phiếu chuyển giao do VSDC vay, mua (nếu TVBT bên bán mất khả năng thanh toán).

Trình tự thực hiện:

Bước 1: Vào chiều ngày E+2, VSDC sẽ gửi điện MT598 đính kèm Thông báo nghĩa vụ thanh toán tiền cho TVBT bên mua, nghĩa vụ chuyển giao chứng khoán cho TVBT bên bán (Báo cáo kết quả phân bổ trái phiếu chuyển giao)

Bước 2: Tại ngày E+3 (ngày thanh toán cuối cùng), VSDC thực hiện chuyển giao chứng khoán, chỉ thị cho NHTT thanh toán tiền và gửi thông báo kết quả thanh toán tiền, chứng khoán cho các TVBT liên quan.

MT546 – Thông báo chuyển giao chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu của tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G	NEWM	Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	RELA	Relation	Số tham chiếu hệ thống phái sinh	:4!c//16x	6

O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin chuyển khoản						
M	16R	TRADDET				9
M	98A	ESET	Date	Ngày hạch toán	:4!c//8!n	10
M	35B		Identification of the Financial Instrument	Chứng khoán chuyển giao vật chất	[ISIN1!e12!c [/2!a/32x]	11
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	12
M	16S	TRADDET				13
Kết thúc Block: Thông tin chuyển khoản						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản chuyển						
M	16R	FIAC				14
M	36B	ESTT	Quantity	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ, chứng khoán phái sinh :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	15
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT bên chuyển	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	16
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản bên chuyển	:4!c//35x	17
M	16S	FIAC				18
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản chuyển						
Bắt đầu Block: Thông tin tài khoản nhận						
M	16R	SETDET				19
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị là :SETR//OWNE	:4!c//4!c	20
M	22F	STCO		Lấy giá trị là :SETR//PHYS		21
M	16R	SETPRTY				22

M	95P	PSET	Party	Lấy giá trị là: VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	23
O	20C	PROC	Reference		:4!c//16x	24
M	16S	SETPRTY				25
M	16R	SETPRTY				26
M	95P	REAG	Party	BICCODE của TVBT bên nhận	:4!c//4!a2!a2 !c[3c]	27
M	97A	SAFE	Account	Số tài khoản giao dịch của NĐT bên nhận	:4!c//35x	28
M	16S	SETPRTY				29
M	16S	SETDET				30
Kết thúc Block: Thông tin tài khoản nhận						

MT544 - Thông báo nhận chuyển giao chứng khoán

Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16R	GENL				1
M	20C	SEME	Reference	Số hiệu tham chiếu của VSDC	:4!c//16x	2
M	23G		Function of the Message	Lấy giá trị NEWM	4!c	3
O	98A	PREP	Preparation Date/	Ngày tạo	:4!c//8!n	4
O	16R	LINK				5
M	20C	RELA	Relation	Số tham chiếu hệ thống phái sinh	:4!c//16x	6
O	16S	LINK				7
M	16S	GENL				8
Kết thúc Block: Thông tin chung						
Bắt đầu Block: Thông tin giao dịch						
M	16R	TRADDET				9
M	98A	ESET		Ngày hiệu lực	:4!c//8!n	10

M	35B			Chứng khoán	[ISIN!e12!c] [/2!a/32x]	11
O	70E	SPRO		Ghi chú	:4!c//10*35x	12
M	16S	TRADDET				13
Kết thúc Block: Thông tin giao dịch						
Bắt đầu Block: Thông tin chi tiết						
M	16R	FLAC				14
M	36B	ESTT	Quantity of financial instrument	Khối lượng Giá trị của qualifier :ESTT//UNIT, sử dụng cho cổ phiếu, chứng chỉ quỹ, chứng khoán phái sinh :ESTT//FAMT, sử dụng cho trái phiếu	:4!c//4!c/15d	15
M	95P	ACOW	Party	BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	16
M	97A	SAFE		Tài khoản của NĐT	:4!c//35x	17
M	16S	FLAC				18
Kết thúc Block: Thông tin chi tiết						
Bắt đầu Block: Thanh toán chi tiết						
M	16R	SETDET				19
M	22F	SETR	Indicator	Lấy giá trị là :SETR//OWNE	:4!c//4!c	20
M	22F	STCO		Lấy giá trị là :SETR//PHYS		21
Bắt đầu Block: Đối tác thanh toán						
M	16R	SETPRTY				22
M	95P	PSET	Place of settlement	Lấy giá trị VSDCSVN06	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	23
M	16S	SETPRTY				24
M	16R	SETPRTY				25
M	95P	DEAG		BICCODE của TVBT bên chuyển	:4!c//4!a2!a2!c[3c]	26
M	97A	SAFE	Account	Tài khoản bên chuyển	:4!c//35x	27

M	16S	SETPRTY				28
Kết thúc Block: Đối tác thanh toán						
M	16S	SETDET		End of block SETDET		29
Kết thúc Block: Thanh toán chi tiết						

MT910 - Thông báo ghi tăng tiền trên tài khoản tiền thanh toán TVBT bên mua (do nộp tiền thanh toán hợp đồng đảo hạn)

Tương tự như đối với MT910 nộp tiền thanh toán lãi/lỗ vị thế

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu tại ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng thanh toán VM Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị: CRED	35x	6

MT900 – Thông báo ghi giảm tiền do thanh toán đảo hạn (khi VSDC ghi giảm tiền trên tài khoản tiền thanh toán của bên mua chuyển cho bên bán)

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu của ngân hàng	16x	2

M	25		Account Identification	Số tài khoản của TVBT tại ngân hàng ghi giảm Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị là DELI	35x	6

MT910 – Thông báo ghi tăng tiền do thanh toán đáo hạn trên tài khoản tiền thanh toán của bên bán

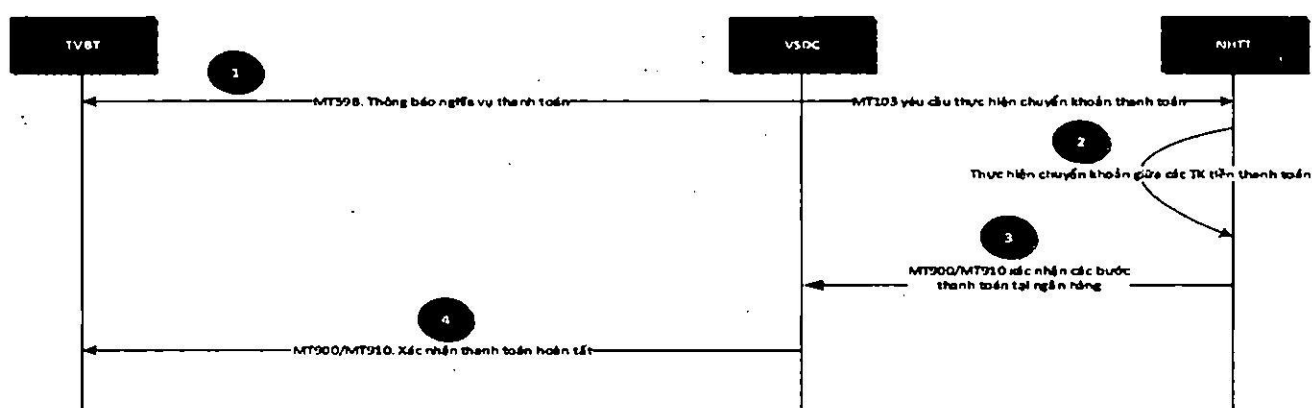
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu của ngân hàng	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản tại ngân hàng được ghi tăng số dư Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị là DELI	35x	6

MT900 - Thông báo ghi giảm trên tài khoản tiền thanh toán bên bán khi Ngân hàng thực hiện chuyển tiền từ tài khoản tiền thanh toán sang tài khoản tiền thành viên đăng ký

Tương tự như đối với thanh toán lãi/lỗ vị thế hàng ngày

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VIETINBANK	16x	1
M	21		Related Reference	Trùng với trường 20	16x	2
M	25		Account Identification	Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Lấy giá trị PAYMENT	6*35x	6

5.2. Thanh toán đáo hạn bằng tiền

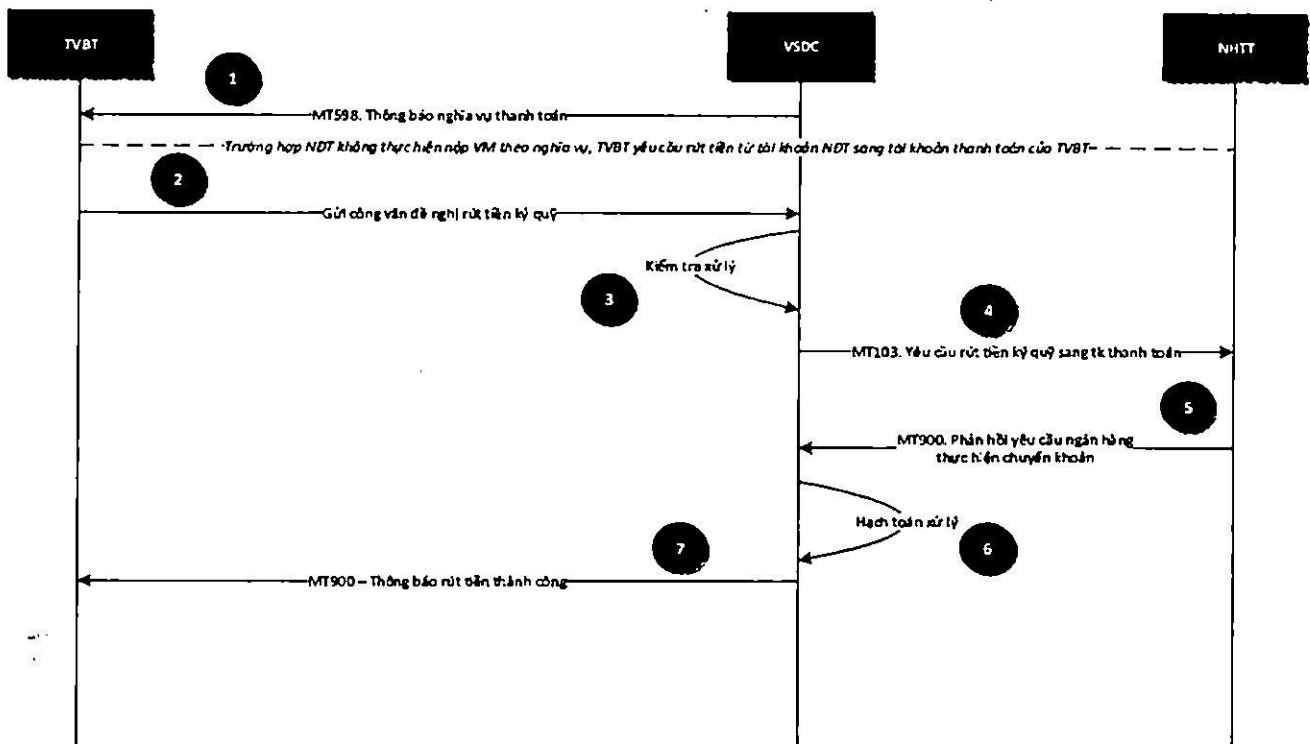


Hợp đồng tương lai chỉ số cổ phiếu thực hiện thanh toán đáo hạn bằng tiền. Hợp đồng tương lai trái phiếu chính phủ có thể thanh toán bằng tiền hoặc chuyển giao vật chất.

Trình tự thực hiện (thực hiện theo quy trình 4.2. Thực hiện thanh toán lãi lỗ vị thế)

6. Xử lý mất khả năng thanh toán

6.1. VSDC yêu cầu rút tiền ký quỹ để thực hiện thanh toán hàng ngày



Trình tự thực hiện:

- Bước 1: VSDC gửi điện MT598 cho TVBT *Thông báo nghĩa vụ thanh toán hàng ngày*

Đối với TVBT không nộp đủ tiền vào TK tiền thanh toán (trong trường hợp mất khả năng thanh toán) và quyết định sử dụng tiền trên tài khoản tiền ký quỹ để hỗ trợ thanh toán thì áp dụng quy trình xử lý theo các bước dưới đây:

- Bước 2: TVBT gửi công văn cho VSDC đề nghị rút tiền từ tài khoản tiền ký quỹ tự doanh/môi giới để thanh toán lãi/lỗ vị thế. *(Trường hợp TVBT không gửi yêu cầu rút tiền ký quỹ để thanh toán lãi/lỗ vị thế, VSDC sẽ chỉ định VIETINBANK chuyển tiền vào TK tiền thanh toán từ các nguồn (ký quỹ tự doanh/NĐT mất khả năng thanh toán, Quỹ bù trừ...))*
- Bước 3: VSDC kiểm tra số dư trên TK tiền ký quỹ:
 - Nếu không đủ, VSDC thông báo lại cho TVBT
 - Nếu đủ, áp dụng bước 4 đến bước 8
- Bước 4: VSDC gửi điện yêu cầu VIETINBANK thực hiện chuyển khoản từ TK tiền ký quỹ sang TK tiền thanh toán TVBT bằng điện MT103
- Bước 5: VIETINBANK xác nhận chuyển khoản thành công bằng điện MT900 (Báo Nợ trên tài khoản tiền ký quỹ TVBT)

- Bước 6: VSDC thực hiện hạch toán trên tài khoản ký quỹ của NĐT/TVBT và gửi điện thông báo cho TVBT
- Bước 7: VSDC sẽ gửi điện MT900 thông báo rút tiền thành công (sau khi có xác nhận của VIETINBANK với VSDC)
Tiếp tục quy trình thanh toán như Bước 2 mục 4.1

MT103 – Yêu cầu rút tiền ký quỹ để thanh toán VM

M	20		<u>Transaction Reference Number</u>	Số hiệu tham chiếu yêu cầu của TVBT	16x	1
M	23B	CRED	Bank Operation Code		4!c	2
M	32A			Ngày hiệu lực/Loại tiền/Số tiền	6!n3!a15d	3
M	50K		Ordering Customer	Thông tin bên chuyển Là tài khoản BICCODE.C hoặc BICCODE.P	34x	4
M	59		Beneficiary Customer	34x: Số tài khoản VM của TVBT Là tài khoản BICCODE.S	34x	5
O	70		Remittance information	IM2VM//Số tài khoản ký quỹ của NĐT	35x	6
M	71A			Lấy giá trị BEN	3!a	7

MT900 – Thông báo rút tiền thành công

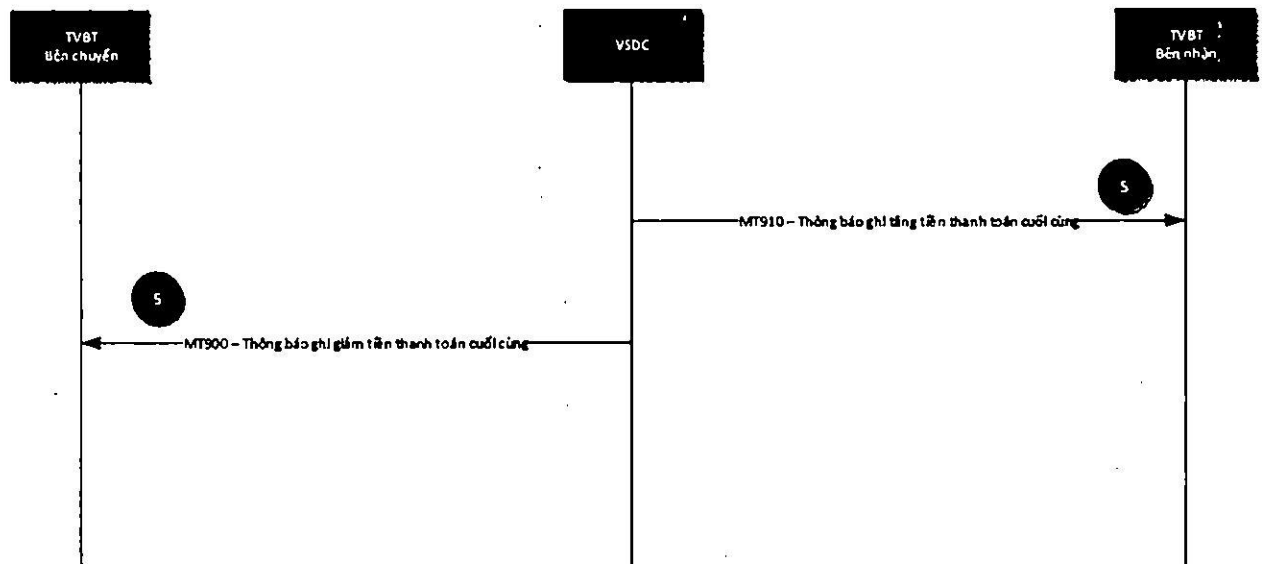
M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu đến yêu cầu rút tiền của TVBT (trường 20 của MT103)	16x	2

M	25		Account Identification	Là giá trị trường 50K của điện MT103	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Là giá trị trường 70 của điện MT103	35x	6

MT910 – Thông báo tăng tiền trên tài khoản thanh toán

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	21		Related Reference	Số hiệu tham chiếu đến yêu cầu rút tiền của TVBT (trường 20 của MT103)	16x	2
M	25		Account Identification	Số tài khoản tại ngân hàng được ghi tăng số dư Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	:4!c//4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	Là giá trị trường 70 của điện MT103	35x	6

6.2. Xử lý mất khả năng thanh toán đảo hạn chuyển giao vật chất (chuyển sang thực hiện thanh toán thay thế bằng tiền)



VSDC sẽ tách nghĩa vụ thanh toán của thành viên bên mất khả năng chuyển giao TPCP (TVMKNTT) và thành viên đối ứng ra để thực hiện thanh toán ngoài hệ thống. Giá trị thanh toán mà TVBTMKNTT phải thanh toán thực hiện theo Quy chế của VSDC.

Bước 1: VSDC gửi cho công văn đề nghị NHTT chuyển tiền từ tài khoản thanh toán của TVMKNTT sang tài khoản thanh toán trung gian của VSDC (ghi nội dung: TTDM)

Bước 2: NHTT gửi điện MT900 báo nợ tài khoản thanh toán của TVMKNTT sang VSDC

MT900 – Báo NỢ nộp tiền thanh toán chuyển giao vật chất

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VIETINBANK	16x	1
M	21		Related Reference	- (số tham chiếu từ hệ thống ngoài vào VTB) -> VTB check lại - Trường hợp không có giá trị lấy F20.	16x	2
M	25		Account Identification	Là tài khoản BICCODE.C hoặc BICCODE.P	35x	3

M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3!c]	5
M	72		Sender to Receiver information	TTDM	6*35x	6

Điện MT900 sẽ được VIETINBANK trả về cho VSDC

Bước 3: NHTT cắt tiền từ tài khoản thanh toán trung gian của VSDC sang tài khoản VM của thành viên bên nhận

Bước 4: NHTT gửi điện MT910 báo có tài khoản VM của thành viên bên nhận cho VSDC

MT910 – Báo CỐ nộp tiền thanh toán chuyển giao vật chất

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu báo CỐ của VIETINBANK	16x	1
M	21		Related Reference	- (số tham chiếu từ hệ thống ngoài vào VTB) -> VTB check lại - Trường hợp không có giá trị lấy F20.	16x	2
M	25		Account Identification	Là tài khoản BICCODE.S	35x	3
M	32A		Value Date, Currency, Amount	Ngày giao dịch Loại tiền Số tiền	6!n3!a15d	4
M	52A			BICCODE của TVBT	4!a2!a2!c[3! c]	5
M	72		Sender to Receiver information	TTDM	73x	6

Điện MT910 sẽ được VIETINBANK trả về cho VSDC

Bước 5: VSDC gửi điện MT910 báo có cho thành viên bên nhận

VSDC gửi điện MT900 báo nợ cho thành viên bên chuyển

7. Báo cáo

7.1 Báo cáo gửi tự động

Cuối ngày, hệ thống CCP sẽ gửi cho TVBT các báo cáo sau:

1	Daily trade Report	TRADE	Thông tin tổng hợp kết quả giao dịch HĐTL của các tài khoản thuộc TVBT	Cuối ngày
2	Position Report	POSITION	Thông tin tất cả các vị thế của một tài khoản, được định giá lãi/lỗ theo giá DSP gần nhất	Cuối ngày
3	Collateral Report	COLLATERAL	Thông tin về tài sản đảm của các tài khoản thuộc TVBT	Cuối ngày
4	Margin Report	MARGIN	Thông tin về giá trị ký quỹ yêu cầu, tỷ lệ sử dụng tài sản đảm bảo cho mỗi tài khoản thuộc TVBT	Cuối ngày
5	Daily settlement Report	SETTLEMENT	Thông tin về giá trị thanh toán cuối ngày của TVBT	Cuối ngày
6	Physical Delivery Report	PHYSICAL	Thông báo HĐTL đáo hạn thực hiện chuyển giao vật chất	Cuối các ngày E+1
7	BOND	BOND	Kết quả phân bổ trái phiếu chuyển giao	Cuối ngày E+2
8	Confirmation Message Report	INST_TRADE	Danh sách chứng khoán phái sinh được phép giao dịch	Cuối ngày
9	Confirmation Message Report	INST_COLLAT	Chứng khoán cơ sở được phép nhận làm tài sản đảm bảo	Cuối ngày

TVBT

MT598 – Thông tin báo cáo
File .csv báo cáo

VSDC

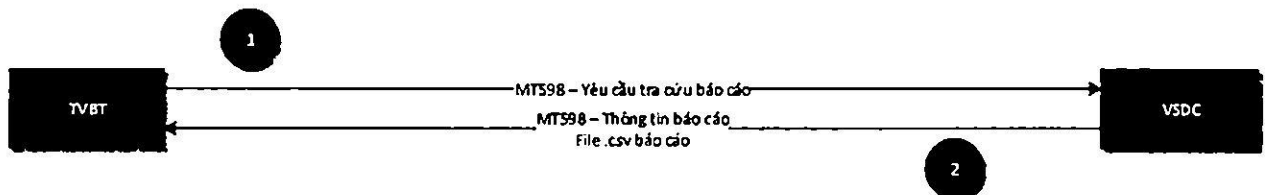
Báo cáo từ số 1 và số 7: sử dụng MT598 – Thông tin chi tiết về báo cáo

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 621	3!n	2
M	77 E		Proprietary Message	Mã báo cáo	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16 R	GENL				4
M	23 G	NEWM	Function of the message	Lấy giá trị NEWM	4!c	5
M	98 A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo báo cáo	:4!c//8!n	6
M	16 R	LINK				7
M	20 C	PREV	Report Reference	Tên file .csv báo cáo	:4!c//16x	8
M	16S	LINK				9
M	20 C	STAT	Report Reference	The name of the report, date-name-recipient [Date]_[Report name]_[Recipient] e.g: • 20160323_Repo rrcode 001	:4!c//35x	10
M	16S	GENL				11
Kết thúc Block: Thông tin chung						

7.2 Báo cáo theo yêu cầu theo TVBT

1	Daily trade Report	TRADE	Thông tin tổng hợp kết quả giao dịch HĐTL của các tài khoản thuộc TVBT	Theo yêu cầu trong ngày
2	Position Report	POSITION	Thông tin tất cả các vị thế của một tài khoản, được định giá lãi/lỗ theo giá DSP gần nhất	Theo yêu cầu trong ngày
3	Collateral Report	COLLATERAL	Thông tin về tài sản đảm của các tài khoản thuộc TVBT	Theo yêu cầu trong ngày

4	Margin Report	MARGIN	Thông tin về giá trị ký quỹ yêu cầu, tỷ lệ sử dụng tài sản đảm bảo cho mỗi tài khoản thuộc TVBT	Theo yêu cầu trong ngày
5	Daily settlement Report	SETTLEMENT	Thông tin về giá trị thanh toán cuối ngày của TVBT	Theo yêu cầu trong ngày
6	Physical Delivery Report	PHYSICAL	Thông báo HĐTL đáo hạn thực hiện chuyển giao vật chất	Theo yêu cầu trong ngày



TVBT có nhu cầu xem:

- Báo cáo nghiệp vụ theo quy chế của VSDC
- Báo cáo được đề cập trong phần 7.1 mà TVBT muốn tra cứu theo thời gian thực loại trừ:
 - + Daily settlement report - Thông tin về giá trị thanh toán cuối ngày của TVBT
 - + Physical Delivery Report: Thông báo HĐTL đáo hạn thực hiện chuyển giao vật chất.

Trình tự thực hiện:

- Bước 1: TVBT gửi bằng điện MT 598 yêu cầu tra cứu báo cáo
- Bước 2: VSDC nhận, xử lý và gửi thông tin báo cáo qua điện MT598 kèm file .csv

Bước 1: MT598 – Yêu cầu tra cứu báo cáo

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của của TVBT	16x	1
M	12		Sub-Message Type	The value is 620	3!n	2

M	77 E		Proprietary Message	Tham số báo cáo (Là các code báo cáo đề cập trong mục 7.1 nêu trên, loại trừ các báo cáo BOND INST_TRADE, INST_COLLAT)	20*78x	3
Start of Block: General information						
M	16 R	GENL		Start of Block GENL		4
M	23 G	NEWM	Function of the message	The value is NEWM	4!c	5
M	98 A	PREP	Preparation Date	Requested Date	:4!c//8!n	6
M	13 B	STAT		Mã báo cáo	:4!c//16x	7
M	16S	GENL		End of Block GENL		8
End of Block: General information						

Bước 2: MT598 – Thông tin chi tiết về báo cáo

M	20		Transaction Reference Number	Số hiệu tham chiếu của VSDC	16x	1
M	12		Sub-Message Type	Lấy giá trị 621	3!n	2
M	77 E		Proprietary Message	Mã báo cáo	73x	3
Bắt đầu Block: Thông tin chung						
M	16 R	GENL				4
M	23 G	NEWM	Function of the message	Lấy giá trị NEWM	4!c	5
M	98 A	PREP	Preparation Date	Ngày tạo báo cáo	:4!c//8!n	6
M	16 R	LINK				7
M	20 C	PREV	Report Reference	Tên file .csv báo cáo	:4!c//16x	8
M	16S	LINK				9
M	20 C	STAT	Report Reference	The name of the report, date-name-recipient [Date]_[Report name]_[Recipient] e.g:	:4!c//35x	10

				• 20160323_Reportcode 001		
M	16S	GENL				11
Kết thúc Block: Thông tin chung						

7.3 Cấu trúc báo cáo

7.3.1 Cấu trúc file .par gửi kèm với kết quả báo cáo như sau:

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
SwiftTime	DateTime	<!SWIFTTIME> Thời điểm xử lý tại VSDC Gateway ISO 8601 datetime format <YYYY-MM-DD>T<HH:MM> Ví dụ: 2007-04-05T14:30
NonRep	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
DeliveryTime	DateTime	<!DELIVERTIME> Thời điểm truyền dữ liệu ISO 8601 datetime format
MsgId	String	<!STPREFSEQID> Số sequence do VSDCGateway tạo ra string length <= 40
Creationtime	DateTime	<\$FILECREATETIME> Thời điểm tạo tệp tin dữ liệu (thuộc tính của file dữ liệu) ISO 8601 datetime format
PDIndication	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
Requestor	UserDN	Thông tin bên gửi (BICCODE của TVBT) o=<\$VSDCBICCODE>, o=swift string length <= 100
Responder	UserDN	Thông tin bên nhận (BICCODE của VSDC) o=<\$MEMBERBICCODE>, o=swift string length <= 100
Service	String	Mặc định là: swift.corp.fast string length <= 30

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
RequestType	String	Mặc định là camt.xxx.fisp.rep ³ string length <= 30
Priority	String	Mặc định là Normal string matches "Normal" "Urgent"
RequestRef	String	<\$REFREQID> Là giá trị trường 20 của điện MT598 kèm theo string length <= 30
TransferRef	String	<\$EVENTCODE> Lấy giá trị là POSITION string length <= 30
TransferDescription	String	<\$EVENTNAME> string matches any* length <= 256 octet
TransferInfo	String	<\$MEMBERBICCODE>.<\$REPORTCODE> <\$SYSDATE>.<\$RequestRef> string matches US ASCII* length <= 256
PossibleDuplicate	Boolean	Mặc định là TRUE string matches "FALSE" "TRUE"
OrigTransferRef	String	Số reference của hệ thống VSDC gửi ra string length <= 30
AckIndicator	Boolean	Mặc định là FALSE string matches "FALSE" "TRUE"
LogicalName		Tên tệp tin dữ liệu Sw filename
FileDescription	String	Mô tả thêm (có thể không dùng) string matches any* length <= 256 octet
FileInfo	String	Mặc định: SwCompression=None string matches US ASCII* length <= 256
Size		<\$FILESIZE> Kích thước tệp tin dữ liệu integer <= 0

³ Financial institution specific

Tên	Loại dữ liệu	Ghi chú - Độ dài hoặc giá trị cho phép
SNLId	String	string length <= 30
SNLEP	String	string length <= 15
AckResponder	UserDN	<Không dùng> string length <= 100
AckRequestType	String	<Không dùng> string length <= 30
DigestAlgorithm	String	<Không dùng> string matches "SHA-1" "SHA-256"
DigestValue	String	<Không dùng> string length <= 50

7.3.2 Cấu trúc file csv gửi kèm các báo cáo như sau:

7.3.2.1. Báo cáo TRADE

No.	Field Name	Description	Content
1	id		
2	state	Trạng thái lệnh	
3	reference	Số hiệu lệnh	
4	settlement	Ngày khớp lệnh	
5	time	Thời gian khớp lệnh	
6	account	Số tài khoản	
7	buy/sell	Mua/bán	
8	code	Mã hợp đồng	
9	instrument name	Tên hợp đồng	
10	quantity	Số lượng	
11	currency	Tiền tệ	
12	price	Giá	

7.3.2.2 Báo cáo POSITION

No.	Field Name	Description	Content
1	id		
2	account	Tài khoản Nhà đầu tư	
3	investor	Tên Nhà đầu tư	
4	code	Mã hợp đồng	
5	name	Tên hợp đồng	
6	deliver	Số lượng phải giao	
7	receive	Số lượng nhận	
8	net	Net	
9	im	IM	
10	vm	VM	
11	wasp	Giá trung bình mua	
12	wapb	Giá trung bình bán	
13	due	Ngày đáo hạn	
14	Value (DSP)	DSP	

7.3.2.3. Báo cáo MARGIN

No.	Field Name	Description	Content
1	account	Tài khoản	
2	clearing member	Tên thành viên	
3	investor	Tên nhà đầu tư	
4	total margin	Tổng ký quỹ	
5	initial margin	Ký quỹ ban đầu	
6	spread margin	Ký quỹ song hành	
7	variation margin	Ký quỹ biến đổi	
8	delivery margin	Ký quỹ chuyển giao	

No.	Field Name	Description	Content
9	total collateral	Tổng tài sản đảm bảo	
10	eligible collateral	Tài sản hợp lệ	
11	percent	Phần trăm	

7.3.2.4. Báo cáo COLLATERAL

No.	Field Name	Description	Content
1	id		
2	clearing member	Tên thành viên	
3	investor	Tên nhà đầu tư	
4	account	Tài khoản	
5	opening balance	Số dư đầu ngày	
6	closing balance	Số dư cuối ngày	
7	instrument	Mã kỹ quỹ	
8	haircut	Harcut	
9	cash	Tiền	
10	securities quantity	Số lượng kỹ quỹ	
11	securities value	Giá trị ký quỹ	
12	difference	Phát sinh trong ngày	

7.3.2.5. Báo cáo SETTLEMENT

No.	Field Name	Description	Content
1	id		
2	clearing member	Tên thành viên	
3	investor	Tên Nhà đầu tư	
4	account	Tài khoản nhà đầu tư	
5	pay	Số tiền phải trả	
6	receive	Số tiền được nhận	

7.3.2.6. Báo cáo PHYSICAL

No.	Field Name	Description	Content
1	cm	Tên thành viên	
2	trading account	Số tài khoản giao dịch	
3	margin account	Số tài khoản ký quỹ	
4	instrument	Mã hợp đồng	
5	short (contracts)	Số hợp đồng bán	
6	long (contracts)	Số hợp đồng mua	
7	final trading date	Ngày giao dịch cuối cùng	
8	settlement date	Ngày thanh toán	

7.3.2.7. Báo cáo BOND

No.	Field Name	Description	Content
1	cm	Thành viên	
2	settlement date	Ngày thanh toán	
3	margin account	Tài khoản nhà đầu tư	
4	deliverable bond code	Mã trái phiếu chuyển giao	
5	receive quantity	Số lượng nhận	
6	pay quantity	Số lượng phải giao	
7	receive value	Giá trị nhận	
8	pay value	Giá trị phải giao	

Cấu trúc file csv danh sách chứng khoán như sau:

7.3.2.8. INST_TRADE – Chứng khoán được phép giao dịch

No.	Field Name	Description	Content
1	Date		YYYYMMDD
2	ISIN		

No.	Field Name	Description	Content
3	Code	HNX trading code	
4	Name	Full instrument name	
5	Live Date	Date instrument can be used on the AvenirClear system	YYYYMMDD
6	Settlement Date	Settlement or Maturity Date	YYYYMMDD
7	Margin Rate	IM Margin rate percentage	11.12 = 11.12%
8	Daily Settlement Price		
9	Place of Listing		

7.3.2.9. INST_COLLAT – Chứng khoán cơ sở được phép làm tài sản đảm bảo

No.	Field Name	Description	Content
1	Date		YYYYMMDD
2	ISIN		
3	Code	HNX or other trading code	
4	Name	Full instrument name	
5	Currency	ISO currency code	
6	Last Price		
7	Haircut %	The haircut percentage	20 = 20%
8	Expiry Date	Date after which Instrument can not be used as collateral	YYYYMMDD

BẢNG 1: BẢNG MÃ LỖI TRẢ VỀ TVBT

Thông tin lỗi	Chú giải
-1	Không thể load được dữ liệu đã ký
-2	Không tìm thấy chữ ký số trong dữ liệu
-3	Chữ ký đã bị thay đổi
-4	Đường dẫn tin tưởng(Trustpath) không hợp lệ
-5	Không tìm thấy chứng thư số của CA
1	Chứng thư số chưa đến hạn sử dụng
2	Chứng thư số đã hết hạn
3	Chứng thư số không có quyền ký
4	Chứng thư số đã bị thu hồi
5	Không thể kiểm tra trạng thái chứng thư số
6	Không thể kiểm tra chứng thư số qua OCSP: Không tồn tại url trong chứng thư số
7	Không tìm thấy chứng thư số trong chữ ký
8	Không thể kiểm tra chứng thư số qua OCSP: response null
9	Không thể kiểm tra chứng thư số qua CRL
10	Không thể kiểm tra chứng thư số qua OCSP: url không tồn tại
11	Chữ ký trong OCSP response không hợp lệ
H01	Header missing/block 1 error.
H02	Header application invalid.
H25	Header formatting error.
H30	Header message type invalid.
H50	Header invalid destination (receiver).
H98	Header invalid source (sender).
H99	Header error.
T02	Unknown error (please contact support).
T27	BIC code formatting error.
T28	BIC code is invalid destination.
T31	Line/Sub-field/Component missing or invalid.
T32	Line/Sub-field/Component not found.
T33	Line/Sub-field/Component too long.
T34	Line/Sub-field/Component too short.
T38	Invalid time.
T40	Invalid amount/number.
T45	Invalid BIC code.
T52	Invalid currency code.
T98	Duplicate message detected.
[content]	Nội dung lỗi cụ thể , ví dụ: Tài khoản không tồn tại

BẢNG 2: BẢNG MÃ CHUYỂN ĐỔI CÁC KÝ TỰ TIẾNG VIỆT VÀ KÝ TỰ ĐẶC BIỆT SANG CHUẨN ISO15022

Ký tự tiếng Việt và ký tự đặc biệt	Ký tự Latin
Ă	?AW?
ă	?aw?
Ơ	?OW?
ơ	?ow?
Ư	?UW?
ư	?uw?
À	?AA?
à	?aa?
Ỗ	?OO?
ô	?oo?
Ề	?EE?
ê	?ee?
À	?AF?
Á	?AS?
À	?AR?
Ã	?AX?
Ạ	?AJ?
à	?af?
á	?as?
à	?ar?
ã	?ax?
ạ	?aj?
Ả	?AAF?
Á	?AAS?
Ả	?AAR?
Ả	?AAX?
Ạ	?AAJ?
à	?aaf?
á	?aas?
à	?aar?
ã	?aax?
ạ	?aaj?
Ả	?AWF?
Ả	?AWS?
Ả	?AWR?

Ky tự tiếng Việt và ký tự đặc biệt	Ky tự Latin
À	?AWX?
Ã	?AWJ?
ä	?awf?
å	?aws?
ä	?awr?
ã	?awx?
ä	?awj?
Đ	?DD?
đ	?dd?
Ê	?EF?
Ê	?ES?
Ê	?ER?
Ê	?EX?
Ê	?EJ?
ê	?ef?
ê	?es?
ê	?er?
ê	?ex?
ê	?ej?
Ê	?EEF?
Ê	?EES?
Ê	?EER?
Ê	?EEX?
Ê	?EEJ?
ê	?eef?
ê	?ees?
ê	?eer?
ê	?eex?
ê	?eej?
Ì	?IF?
Ì	?IS?
Ì	?IR?
Ì	?IX?
Ì	?IJ?
ì	?if?
ì	?is?
ì	?ir?
ì	?ix?

Ky tự tiếng Việt và ký tự đặc biệt	Ky tự Latin
!	?j??
Ò	?OF?
Ó	?OS?
Ô	?OR?
Õ	?OX?
Ö	?OJ?
ó	?of?
ô	?os?
ơ	?or?
õ	?ox?
ø	?oj?
Ø	?OOF?
Ö	?OOS?
Ò	?OOR?
Ó	?OOX?
Ô	?OOJ?
ó	?oof?
ô	?oos?
ơ	?oor?
õ	?oox?
ø	?ooj?
Ø	?OWF?
Ö	?OWS?
Ò	?OWR?
Ó	?OWX?
Ô	?OWJ?
ó	?owf?
ô	?ows?
ơ	?owr?
õ	?owx?
ø	?owj?
Ø	?UF?
Ö	?US?
Ò	?UR?
Ó	?UX?
Ô	?UJ?
ó	?uf?
ø	?us?

Ký tự tiếng Việt và ký tự đặc biệt	Ký tự Latin
ủ	?ur?
ũ	?ux?
ụ	?uj?
Ừ	?UWF?
Ứ	?UWS?
Ỡ	?UWR?
Ỡ	?UWX?
Ự	?UWJ?
ừ	?uwf?
ứ	?uws?
ỡ	?uwr?
ỡ	?uwx?
ự	?uwj?
ỳ	?yf?
ý	?ys?
ỹ	?yx?
ỵ	?yj?
ỷ	?yr?
Ỡ	?YF?
Ỡ	?YS?
Ỡ	?YX?
Ỡ	?YJ?
Ỡ	?YR?
/	?_?
&	?_38?
#	?_35?
%	?_37?
\	?_92?

VD1: Chuỗi ký tự gốc mà bên gửi tạo trước khi thực hiện chuyển đổi: 4 ký tự KHÓA

Điện ISO 15022 sau khi chuyển đổi: 7 ký tự

KH?OS?A

Chuỗi ký tự bên nhận chuyển đổi lại: 4 ký tự

KHÓA

VD 2: Chuỗi ký tự gốc mà bên gửi tạo trước khi thực hiện chuyển đổi

CÔNG TY SỮA

Điện ISO 15022 sau khi chuyển đổi

C?OO?NG TY S?UWX?A

Chuỗi ký tự bên nhận chuyển đổi lại:
CÔNG TY SỮA