УЧЕБНЫЙ ЦЕНТР РОССВИФТ

Программа и расписание семинара

ISO 15022 Securities Settlement and Reconciliation

Программа семинара

1. Краткая справка:
   - использование SWIFT в России,
   - стандарт ISO 15022 и принципы его разработки (юридические аспекты),
   - рабочая группа SMPG и NSMPG (информация о SWIFT-RUS – руководство для российских пользователей).
2. Основные принципы стандарта ISO 15022:
   - структура сообщений, понятие последовательности, подпоследовательности (вложенные подпоследовательности),
   - понятия обязательности полей и блоков,
   - концепция общих полей (generic fields), дискретные поля
   - правила описания формата поля:
     - структура поля
     - опции формата
     - определители
     - повторяемость
     - примеры наиболее часто используемых полей.
3. Сообщения стандарта ISO 15022:
   - основные группы сообщений 5-й категории,
   - типы сообщений и их распределение по группам,
   - описание основных потоков сообщений между участниками рынка.
4. Формат сообщений – поручений MT 540-543 на примере сообщения MT 541:
   - основные блоки сообщения и примеры их заполнения:
     - общая информация,
     - детали сделки,
     - финансовый инструмент/ счет,
     - стороны по расчетам,
     - иные стороны
   - отличия сообщений на поставку и на прием ценных бумаг,
   - отличия сообщений FOP и DVP.
5. Примеры сообщений:
   - поставка против платежа, пакет инструкций и соответствующие референсы,
   - отмена ранее направленных инструкций,
   - расчеты по операциям РЕПО (одно или два сообщения по операции, замена обеспечения, трансформация, частичный возврат или дополнительное обеспечение, ролл-овер)

6. Отличие отчетов об исполнении операции от соответствующих поручений:
   - изменение обязательности подпоследовательностей,
   - различие в указании количества ценных бумаг, дат и сумм (фактические).
7. Извещение о статусе исполнения операции и уведомление о наличии встречных непарных инструкций (allegement) контрагента.
8. Примеры сообщений:
   - подтверждения по результатам проведения частичных расчетов,
   - запрос выписки,
   - отчет о незавершенных операциях (pending transactions),
   - выписки об остатках и об операциях по счету и др.
9. Правила определения ошибок при отправке сообщений (NAK, ACK).
10. Операции при проведении расчетов по счетам, открытым в двух разных международных депозитариях(bridge).
11. Дополнительные примеры:
    - выставление заявки на покупку и/или продажу,
    - распределение приобретенного пакета по нескольким клиентам,
    - изменение отдельных признаков исполнения операции (MT530).
12. Коммуникационная сессия с участниками семинара. Подведение итогов.

Расписание дня

ВРЕМЯ	АКТИВНОСТЬ
08:45 – 09:00	○ Подключение слушателей, проверка качества связи
09:00 – 10:50	○ Проведение семинара согласно программе выше
10:50 – 11:05	*Перерыв 15 минут*
11:05 – 12:55	○ Проведение семинара согласно программе выше
12:55 – 13:55	*Перерыв 60 минут*
13:55 – 15:45	○ Проведение семинара согласно программе выше
15:45 – 16:00	*Перерыв 15 минут*
16:00 – 17:45 17:45 – 18:00	○ Обсуждение вопросов согласно программе семинара ○ Коммуникационная сессия с участниками семинара