

QUYẾT ĐỊNH

Về việc ban hành Quy chế hoạt động tạo lập thị trường và phòng ngừa rủi ro của tổ chức phát hành chứng quyền có bảo đảm tại Sở Giao dịch Chứng khoán
Thành phố Hồ Chí Minh

TỔNG GIÁM ĐỐC SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

Căn cứ Luật Chứng khoán số 70/2006/QH11 ngày 29/06/2006 và Luật sửa đổi, bổ sung một số điều của Luật Chứng khoán số 62/2010/QH12 ngày 24/11/2010 ;

Căn cứ Nghị định số 58/2012/NĐ-CP ngày 20/07/2012 của Chính phủ quy định chi tiết và hướng dẫn thi hành một số điều của Luật Chứng khoán và Luật sửa đổi, bổ sung một số điều của Luật Chứng khoán và Nghị định số 60/2015/NĐ-CP ngày 26/06/2015 của Chính phủ sửa đổi, bổ sung một số điều của Nghị định số 58/2012/NĐ-CP;

Căn cứ Thông tư số 203/2015/TT-BTC ngày 21/12/2015 của Bộ Tài chính hướng dẫn về giao dịch trên thị trường chứng khoán;

Căn cứ Thông tư số 107/2016/TT-BTC ngày 29/06/2016 của Bộ Tài chính hướng dẫn chào bán và giao dịch chứng quyền có bảo đảm;

Căn cứ Quyết định số 599/QĐ-TTg ngày 11/05/2007 của Thủ tướng Chính phủ về việc chuyển Trung tâm Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh thành Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh;

Căn cứ Quyết định số 2399/QĐ-BTC ngày 21/11/2017 của Bộ trưởng Bộ Tài chính về việc ban hành Điều lệ tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh;

Căn cứ Quyết định số 72/QĐ-UBCK ngày 18/01/2018 của Chủ tịch Ủy ban chứng khoán Nhà nước về việc ban hành Quy chế hướng dẫn chào bán và phòng ngừa rủi ro chứng quyền có bảo đảm;

Căn cứ Nghị quyết số 01/NQ-SGDHCM ngày 23/02/2018 của Hội đồng Quản trị Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh về việc chấp thuận ban hành Quy chế hoạt động tạo lập thị trường và phòng ngừa rủi ro của tổ chức phát hành chứng quyền có bảo đảm tại Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh;

Căn cứ Công văn số 1100/UBCK-PTTT ngày 09/02/2018 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc chấp thuận ban hành bộ Quy chế về chứng quyền có bảo đảm tại Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh;

Theo đề nghị của Giám đốc phòng Quản lý Thành viên,



QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này Quy chế hoạt động tạo lập thị trường và phòng ngừa rủi ro của tổ chức phát hành chứng quyền có bảo đảm tại Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh.

Điều 2. Quyết định này có hiệu lực kể từ ngày ký.

Điều 3. Giám đốc phòng Quản lý Thành viên, Giám đốc các phòng ban thuộc Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh, các tổ chức và cá nhân có liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. *mu*

KT. TỔNG GIÁM ĐỐC
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC PHỤ TRÁCH



Nguyễn Vũ Quang Trung

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN (đề b/cáo);
- TTLKCKVN;
- HĐQT, BKS;
- Lưu: VT, TV (18) *3*



QUY CHẾ HOẠT ĐỘNG TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG VÀ PHÒNG NGỪA RỦI RO CỦA TỔ CHỨC PHÁT HÀNH CHỨNG QUYỀN CÓ BẢO ĐẢM TẠI SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

(Ban hành kèm theo Quyết định số 68./QĐ-SGDHCM ngày 02 tháng 03 năm 2018 của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh)

**Chương I
QUY ĐỊNH CHUNG**

Điều 1. Phạm vi điều chỉnh và đối tượng áp dụng

Quy chế này quy định về hoạt động tạo lập thị trường và phòng ngừa rủi ro của tổ chức phát hành chứng quyền có bảo đảm tại Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (sau đây gọi tắt là SGDCK Tp.HCM).

Đối tượng áp dụng là tổ chức phát hành chứng quyền có bảo đảm và các tổ chức, cá nhân có liên quan.

Điều 2. Giải thích từ ngữ

Trong Quy chế này, các từ ngữ sau đây được hiểu như sau:

1. **Chứng quyền có bảo đảm** (sau đây gọi tắt là chứng quyền) là hợp đồng giữa nhà đầu tư và tổ chức phát hành chứng quyền, được quy định tại khoản 1 Điều 2 Thông tư số 107/2016/TT-BTC ngày 29/6/2016 của Bộ Tài chính hướng dẫn chào bán và giao dịch chứng quyền có bảo đảm (sau đây gọi tắt là Thông tư 107).

2. **Tổ chức phát hành chứng quyền** (sau đây gọi tắt là tổ chức phát hành) là công ty chứng khoán phát hành chứng quyền.

3. **Chứng khoán cơ sở** là cổ phiếu được sử dụng làm tài sản cơ sở của chứng quyền.

4. **Tạo lập thị trường** là hoạt động đặt lệnh chào mua và/hoặc chào bán của tổ chức phát hành khi xảy ra các trường hợp phải thực hiện nghĩa vụ yết giá tạo lập thị trường quy định tại Quy chế này nhằm tạo thanh khoản cho chứng quyền của tổ chức phát hành đó. Giao dịch tạo lập thị trường thực hiện trên tài khoản tự doanh của tổ chức phát hành (sau đây gọi là tài khoản tạo lập thị trường) và được quản lý tách biệt theo mã nhận diện lệnh do SGDCK Tp.HCM cung cấp.

5. **Mã nhận diện lệnh** (Trader ID) là mã trên hệ thống giao dịch do SGDCK Tp.HCM cấp cho công ty chứng khoán.

6. **Vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết** là vị thế được tính toán căn cứ trên phương án phòng ngừa rủi ro đã được tổ chức phát hành nêu trong Bản cáo bạch.

7. *Vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế* là vị thế được tính toán căn cứ trên vị thế thực tế có trong tài khoản phòng ngừa rủi ro của tổ chức phát hành.

Chương II **HOẠT ĐỘNG TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG**

Điều 3. Quy định về hoạt động tạo lập thị trường của tổ chức phát hành

1. Tổ chức phát hành có trách nhiệm thực hiện hoạt động tạo lập thị trường theo quy định tại khoản 1 Điều 11 Thông tư 107.
2. Tổ chức phát hành thực hiện hoạt động tạo lập thị trường theo quy định tại Điều 11 Thông tư 107 phải là công ty chứng khoán thành viên của SGDCK Tp.HCM.
3. Tổ chức phát hành được chuyển số chứng quyền chưa phân phối hết vào tài khoản tạo lập thị trường và được tiếp tục phân phối trên hệ thống giao dịch của SGDCK Tp.HCM sau khi niêm yết.

Điều 4. Quyền của tổ chức phát hành khi thực hiện tạo lập thị trường

1. Đề xuất, kiến nghị các vấn đề liên quan đến hoạt động của tổ chức tạo lập thị trường tại SGDCK Tp.HCM.
2. Được giảm giá dịch vụ giao dịch khi đặt lệnh trên tài khoản tạo lập thị trường. Điều kiện được giảm giá dịch vụ giao dịch cụ thể do SGDCK Tp.HCM quy định phù hợp với quy định của Bộ Tài chính.
3. Các quyền khác theo quy định của pháp luật.

Điều 5. Nghĩa vụ của tổ chức phát hành khi thực hiện tạo lập thị trường

1. Có cơ sở vật chất kỹ thuật đảm bảo cho hoạt động tạo lập thị trường.
2. Chỉ được đặt lệnh thông qua tài khoản tạo lập thị trường và mã nhận diện lệnh do SGDCK Tp.HCM cung cấp.
3. Tuân thủ quy định về nghĩa vụ yết giá và nguyên tắc yết giá tạo lập thị trường tại Điều 6 Quy chế này.
4. Tuân thủ chế độ báo cáo và công bố thông tin theo quy định.
5. Tuân thủ các quy định của pháp luật và các quy chế, quy định khác của SGDCK Tp.HCM.

Điều 6. Nghĩa vụ yết giá tạo lập thị trường

1. Tổ chức phát hành phải tham gia đặt lệnh tạo lập thị trường trong vòng năm (05) phút kể từ khi có một trong các sự việc sau đây xảy ra:
 - a. Chỉ có lệnh bên mua hoặc bên bán chứng quyền;
 - b. Không có lệnh bên mua và bên bán chứng quyền;
 - c. Tỷ lệ chênh lệch giá trên thị trường vượt quá 5%. Tỷ lệ chênh lệch giá là tỷ lệ phần trăm của (giá chào bán thấp nhất - giá chào mua cao nhất)/giá chào mua cao nhất.

2. Khi tham gia đặt lệnh theo quy định tại khoản 1 Điều này, tổ chức tạo lập thị trường phải tuân thủ:

- a. Khối lượng mỗi lệnh tối thiểu là 100 chứng quyền;
- b. Loại lệnh sử dụng là lệnh giới hạn;
- c. Giá đặt lệnh phải đảm bảo không vượt tỷ lệ chênh lệch giá quy định tại điểm c khoản 1 Điều này;
- d. Trường hợp không có lệnh mua và lệnh bán chứng quyền, tổ chức tạo lập thị trường phải yết giá hai chiều (đặt cả lệnh chào mua và lệnh chào bán);
- e. Thời gian tồn tại của lệnh trên hệ thống giao dịch tối thiểu là một (01) phút.

3. Trong các trường hợp sau, tổ chức phát hành không phải thực hiện hoạt động tạo lập thị trường:

- a. Đợt khớp lệnh định kỳ xác định giá mở cửa, năm (05) phút đầu sau khi kết thúc đợt khớp lệnh định kỳ xác định giá mở cửa và đợt khớp lệnh định kỳ xác định giá đóng cửa;
- b. Tài sản cơ sở của chứng quyền bị tạm ngừng giao dịch;
- c. Giá lý thuyết của chứng quyền được tính theo công thức nêu tại bản cáo bạch của tổ chức phát hành nhỏ hơn hoặc bằng 10 đồng;
- d. Số lượng chứng quyền trên tài khoản tạo lập thị trường không đáp ứng số lượng tối thiểu theo quy định tại điểm a khoản 2 Điều này, tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh bán;
- e. Chưa có chứng quyền nào được lưu hành (trường hợp tổ chức phát hành chưa bán được chứng quyền nào cho nhà đầu tư), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh mua;
- f. Trường hợp thực hiện hủy niêm yết chứng quyền, tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh bán;
- g. Giá chứng quyền tăng kịch trần (dư mua trần), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh bán hoặc giá chứng quyền giảm kịch sàn (dư bán sàn), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh mua;
- h. Giá chứng khoán cơ sở tăng kịch trần (dư mua trần), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh bán đối với chứng quyền mua và được miễn đặt lệnh mua đối với chứng quyền bán;
- i. Giá chứng khoán cơ sở giảm kịch sàn (dư bán sàn), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh mua đối với chứng quyền mua và được miễn đặt lệnh bán đối với chứng quyền bán;
- j. Chứng quyền đang ở trạng thái có lãi từ 30% trở lên (tức là chứng quyền mua đang có giá chứng khoán cơ sở cao hơn 30% so với giá thực hiện hoặc chứng quyền bán đang có giá chứng khoán cơ sở thấp hơn 30% so với giá thực hiện), tổ chức phát hành được miễn đặt lệnh bán;
- k. Trong 14 ngày trước khi chứng quyền đáo hạn;

- l. Khi xảy ra các sự kiện bất khả kháng như thiên tai, hỏa hoạn, chiến tranh...;
- m. Các trường hợp khác được SGDCK Tp.HCM áp dụng sau khi có ý kiến chấp thuận của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước.
4. SGDCK Tp.HCM thực hiện giám sát việc yết giá tạo lập thị trường của tổ chức phát hành và yêu cầu tổ chức phát hành giải trình nếu cần.

CHƯƠNG III

HOẠT ĐỘNG PHÒNG NGỪA RỦI RO

Điều 7. Quy định về hoạt động phòng ngừa rủi ro

1. Tổ chức phát hành phải đảm bảo có tối thiểu 01 nhân viên thực hiện hoạt động phòng ngừa rủi ro theo quy định tại khoản 1 Điều 12 Thông tư 107.
2. Tổ chức phát hành phải đảm bảo có đủ số lượng chứng khoán cơ sở để phòng ngừa rủi ro cho chứng quyền đang lưu hành theo quy định tại khoản 2 Điều 12 Thông tư 107.
3. Giao dịch phòng ngừa rủi ro được thực hiện trên tài khoản tự doanh và được quản lý tách biệt theo mã nhận diện lệnh do SGDCK Tp.HCM cung cấp. Hoạt động giao dịch phòng ngừa rủi ro trên tài khoản này phải đảm bảo quy định tại khoản 3 Điều 12 Thông tư 107.
4. Việc thực hiện phòng ngừa rủi ro và quản lý vị thế phòng ngừa rủi ro áp dụng cho từng chứng quyền.

Điều 8. Xử lý các trường hợp không tuân thủ phương án phòng ngừa rủi ro

1. Yêu cầu tổ chức phát hành giải trình nếu chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế vượt quá 20% trong vòng 03 ngày làm việc liên tục và không thuộc trường hợp quy định tại khoản 2 Điều này. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày SGDCK Tp.HCM có công văn yêu cầu giải trình, tổ chức phát hành phải thực hiện phòng ngừa rủi ro để giảm chênh lệch xuống bằng hoặc dưới 20% theo quy định tại điểm a khoản 5 Điều 12 Thông tư 107.
2. Yêu cầu tổ chức phát hành nộp tiền tương ứng với phần chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế tính theo giá thị trường nếu chênh lệch này vượt quá 50% trong 03 ngày làm việc liên tục theo quy định tại điểm b khoản 5 Điều 12 Thông tư 107. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày SGDCK Tp.HCM có thông báo yêu cầu nộp tiền, tổ chức phát hành phải nộp khoản tiền này vào tài khoản tự doanh và báo cáo SGDCK Tp.HCM kèm xác nhận của ngân hàng về số dư của tài khoản tự doanh này.
3. Trường hợp tổ chức phát hành không thực hiện phòng ngừa rủi ro theo quy định tại khoản 1 Điều này và bị SGDCK Tp.HCM yêu cầu giải trình đến lần thứ ba hoặc không nộp tiền theo quy định tại khoản 2 Điều này, chứng quyền của tổ chức phát hành sẽ bị cảnh báo trên toàn thị trường.

4. Chứng quyền được đưa ra khỏi diện cảnh báo nếu tổ chức phát hành duy trì được mức chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế không vượt quá 20% trong vòng 30 ngày giao dịch hoặc tổ chức phát hành đã nộp tiền theo quy định tại khoản 2 Điều này.

5. Trường hợp sau khi bị cảnh báo toàn thị trường, tổ chức phát hành vẫn không thực hiện phòng ngừa rủi ro để giảm mức chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế xuống bằng hoặc dưới 20% hoặc không nộp tiền theo quy định tại khoản 2 Điều này, trong vòng 10 ngày làm việc kể từ ngày bị cảnh báo, SGDCK Tp.HCM trình Ủy ban Chứng khoán Nhà nước thực hiện tạm ngừng giao dịch toàn bộ chứng quyền đã phát hành.

6. Chứng quyền được đưa ra khỏi diện tạm ngừng giao dịch nếu tổ chức phát hành duy trì được mức chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế không vượt quá 20% trong vòng 30 ngày giao dịch hoặc tổ chức phát hành đã nộp tiền theo quy định tại khoản 2 Điều này.

7. Trong vòng 10 ngày làm việc kể từ ngày chứng quyền bị tạm ngừng giao dịch, tổ chức phát hành vẫn không thực hiện đưa mức chênh lệch giữa vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết và vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế xuống bằng hoặc dưới 20% và không có phương án xử lý phù hợp, SGDCK Tp.HCM trình Ủy ban Chứng khoán Nhà nước thực hiện hủy niêm yết toàn bộ chứng quyền đã phát hành.

Chương IV **CHẾ ĐỘ BÁO CÁO**

Điều 9. Các loại báo cáo và thời hạn nộp

1. Báo cáo ngày: Tổ chức phát hành phải báo cáo SGDCK Tp.HCM về hoạt động phòng ngừa rủi ro và số lượng chứng quyền đã chào bán trong ngày chậm nhất vào 17 giờ ngày làm việc tiếp theo theo mẫu quy định tại Phụ lục 01 ban hành kèm theo Quy chế này và đúng với phương án đã được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước chấp thuận.

2. Báo cáo tháng: Trong thời hạn 10 ngày kể từ ngày kết thúc tháng, tổ chức phát hành phải báo cáo SGDCK Tp.HCM theo mẫu quy định tại Phụ lục 02 ban hành kèm theo Quy chế này, bao gồm:

- a) Báo cáo tình hình thực hiện nghĩa vụ tạo lập thị trường;
- b) Báo cáo về các giao dịch tự doanh đối với chứng khoán cơ sở;
- c) Báo cáo về vị thế mở và giá trị hiện tại của tất cả các chứng quyền.

3. Báo cáo theo yêu cầu: Trường hợp cần thiết, tổ chức phát hành phải báo cáo bằng văn bản theo yêu cầu của SGDCK Tp.HCM.

Điều 10. Hình thức nộp báo cáo

1. Tổ chức phát hành có nghĩa vụ nộp báo cáo dưới hình thức văn bản và dữ liệu điện tử cho SGDCK Tp.HCM. Báo cáo bằng dữ liệu điện tử phải sử dụng bảng mã Unicode. Người đại diện theo pháp luật hoặc người được ủy quyền báo cáo của tổ

chức phát hành phải đăng ký địa chỉ hộp thư điện tử để gửi báo cáo cho SGDCK Tp.HCM.

2. Trong trường hợp gửi báo cáo qua fax/mạng điện tử, tổ chức phát hành phải gửi báo cáo bằng văn bản chậm nhất là 05 ngày làm việc kể từ ngày hết hạn gửi báo cáo. Ngày báo cáo cho SGDCK Tp.HCM được tính là ngày gửi fax, dữ liệu điện tử (qua email hoặc hệ thống công nghệ thông tin tiếp nhận báo cáo, công bố thông tin) hoặc ngày SGDCK Tp.HCM nhận được báo cáo bằng văn bản đầy đủ và hợp lệ.

Chương V **XỬ LÝ VI PHẠM**

Điều 11. Nguyên tắc xử lý vi phạm

1. Việc xử lý vi phạm sẽ căn cứ vào tính chất, mức độ vi phạm, thời gian, tần suất xảy ra vi phạm, mức độ tác động và thiệt hại phát sinh từ vi phạm để quyết định hình thức xử lý vi phạm phù hợp.

2. Đối với các vi phạm nghiêm trọng, vi phạm lặp lại nhiều lần hoặc vi phạm ảnh hưởng đến quyền và lợi ích của nhà đầu tư, SGDCK Tp.HCM xử lý vi phạm đồng thời công bố thông tin trên các phương tiện công bố thông tin của SGDCK Tp.HCM.

Điều 12. Các hình thức xử lý vi phạm

1. Nhắc nhở.
2. Cảnh cáo.
3. Cảnh báo toàn thị trường.
4. Tạm ngừng hoạt động tạo lập thị trường.
5. Chấm dứt hoạt động tạo lập thị trường.

Chương VI **TẠM NGỪNG, CHẤM DỨT HOẠT ĐỘNG TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG**

Điều 13. Tạm ngừng hoạt động tạo lập thị trường

SGDCK Tp.HCM tạm ngừng hoạt động tạo lập thị trường của tổ chức phát hành trong các trường hợp sau:

1. Hoạt động tạo lập thị trường không tuân thủ một trong các nghĩa vụ quy định tại Điều 5 Quy chế này và tùy từng trường hợp, mức độ vi phạm, SGDCK Tp.HCM sẽ xem xét tạm ngừng hoạt động tạo lập thị trường.

2. Tổ chức phát hành là thành viên giao dịch bị SGDCK Tp.HCM đình chỉ hoạt động giao dịch.

3. Chứng quyền do tổ chức phát hành bị tạm ngừng giao dịch.

4. Tổ chức phát hành không thể thực hiện hoạt động tạo lập thị trường vì những lý do bất khả kháng và được SGDCK Tp.HCM chấp thuận. Trong trường hợp này, tổ chức phát hành phải báo cáo SGDCK Tp.HCM theo mẫu quy định tại Phụ lục 03 ban hành kèm theo Quy chế này.

Điều 14. Chấm dứt hoạt động tạo lập thị trường

1. Tổ chức phát hành bị chấm dứt hoạt động tạo lập thị trường trong các trường hợp sau:

a. Hoạt động tạo lập thị trường không tuân thủ một trong các nghĩa vụ quy định tại Điều 5 Quy chế này và tùy từng trường hợp, mức độ vi phạm, SGDCK Tp.HCM sẽ xem xét chấm dứt hoạt động tạo lập thị trường;

b. Tổ chức phát hành là thành viên giao dịch bị SGDCK Tp.HCM ngừng giao dịch để chấm dứt tư cách thành viên;

c. Chứng quyền do tổ chức phát hành bị hủy niêm yết;

d. Các trường hợp khác để bảo vệ quyền lợi của nhà đầu tư sau khi được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước chấp thuận.

2. Ngày chấm dứt hoạt động tạo lập thị trường do SGDCK Tp.HCM quyết định.

Chương VII TỔ CHỨC THỰC HIỆN

Điều 15. Điều khoản thi hành

1. SGDCK Tp.HCM thực hiện giám sát việc tuân thủ Quy chế này đối với các đối tượng được quy định tại Điều 1.

2. Trong quá trình thực hiện nếu có khó khăn, vướng mắc đề nghị các tổ chức, cá nhân phản ánh về SGDCK Tp.HCM để phối hợp giải quyết.

3. Việc sửa đổi, bổ sung Quy chế này do Tổng Giám đốc SGDCK Tp.HCM quyết định sau khi Hội đồng Quản trị SGDCK Tp.HCM thông qua và được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước chấp thuận. / *mc*

**KT. TỔNG GIÁM ĐỐC
PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC PHỤ TRÁCH**



Nguyễn Vũ Quang Trung



Phụ lục 01

(Ban hành kèm theo Quyết định số 80/QĐ-SGDHCM ngày 02/03/2018 của Tổng Giám đốc
Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh)

TÊN TỔ CHỨC PHÁT HÀNH
Số:.....

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

....., ngày..... tháng năm

BÁO CÁO HOẠT ĐỘNG PHÒNG NGỪA RỦI RO

Kính gửi: Sở Giao dịch Chứng khoán TP. HCM

A. Báo cáo vị thế cho các chứng quyền

I. Báo cáo vị thế cho các chứng quyền trên tài sản cơ sở A:

1. Báo cáo vị thế cho từng chứng quyền:

1.1. Chứng quyền A1: mã chứng quyền ABC...

- Loại chứng quyền: [] Mua
- Kiểu thực hiện: Châu Âu
- Phương thức thanh toán thực hiện quyền: thanh toán tiền
- Thời hạn: ngày
- Ngày đáo hạn:
- Tỷ lệ chuyển đổi:
- Giá thực hiện:

Báo cáo số lượng chứng quyền lưu hành

1	Số lượng chứng quyền được phép phát hành	
2	Số lượng chứng quyền đã bán ròng trong ngày	
3	Tổng số lượng chứng quyền đã bán ròng (số lượng chứng quyền đang lưu hành)	
4	Số lượng chứng quyền còn được phép bán (1 – 3)	

1.2 Chứng quyền A2 (nếu có)

2. Báo cáo vị thế phòng ngừa rủi ro cho các chứng quyền trên tài sản cơ sở A:

- Công thức áp dụng:
- Giá trị các thông số đầu vào:
- Số tài khoản tự doanh tiền gửi đăng ký cho hoạt động phòng ngừa rủi ro mở tại Ngân hàng:
- Vị thế phòng ngừa rủi ro:



Ngày	Mã CW	Vị thế rủi ro lý thuyết	Vị thế rủi ro thực tế (tính trên số lượng chứng khoán cơ sở thực có trong tk tự doanh)	Chênh lệch	Tổng số lượng chứng khoán cơ sở đã mua đang chờ về	Số dư tiền tài khoản tự doanh
01	Call A1					
01	Call A2					
01						
01	Tổng vị thế:					

II. Báo cáo vị thế cho các chứng quyền trên tài sản cơ sở B: (nếu có)

.....

B. Báo cáo hoạt động phòng ngừa rủi ro

TT	Mã cổ phiếu cơ sở	Số lượng CP dư đầu ngày (1)	Số lượng CP giao dịch trong ngày		Số lượng CP cuối ngày (4) = (1) + (2) - (3)	Tỷ lệ nắm giữ/CP lưu hành
			Mua (2)	Bán (3)		
01						
02						
03						
	Tổng					

Công ty cam kết các số liệu báo cáo trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu trách nhiệm trước pháp luật về các nội dung đã báo cáo.

Tài liệu đính kèm:

Người đại diện theo pháp luật/Tổng Giám đốc
(Ký, ghi rõ họ tên, chức vụ, đóng dấu)





Phụ lục 02

**MẪU BÁO CÁO NGHĨA VỤ TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG VÀ
PHÒNG NGỪA RỦI RO CỦA TỔ CHỨC PHÁT HÀNH**

(Ban hành kèm theo Quyết định số 63/QĐ-SGDHCM ngày 02/03/2015 của Tổng Giám đốc
Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh)

TÊN TỔ CHỨC PHÁT HÀNH
Số:.....

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

....., ngày..... tháng năm

**BÁO CÁO NGHĨA VỤ TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG VÀ
PHÒNG NGỪA RỦI RO CỦA TỔ CHỨC PHÁT HÀNH**
Kỳ báo cáo: Tháng Năm

Kính gửi: Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh.

- Tổ chức phát hành:
- Giấy phép thành lập và hoạt động số:
- Trụ sở chính
- Điện thoại:
- Email:
- Website:
- Ngân hàng lưu ký:

Fax:



A. BÁO CÁO NGHĨA VỤ TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG:

Ngày thực hiện	Tên chứng quyền	Loại giao dịch (Mua/Bán)	Chi tiết		
			Khối lượng	Giá	Tổng giá trị

B. BÁO CÁO VỀ CÁC GIAO DỊCH TỰ DOANH ĐỐI VỚI CHỨNG KHOÁN CƠ SỞ

STT	Loại chứng khoán	Chứng khoán nắm giữ tại ngày / /				Tổng số CK đang lưu hành của tổ chức phát hành vào thời điểm báo cáo	Tỷ lệ đầu tư (%)
		Số lượng	Tổng giá trị mua vào (triệu đồng)	Giá trị thị trường tại thời điểm báo cáo (triệu đồng)	Tỷ lệ tăng trưởng TS đầu tư (%)		
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6) = (5)/(4)	(7)	(8)=(3)/(7)
I. Phòng ngừa rủi ro							
	Cổ phiếu						
	Tổng cộng						
II. Khác							
	Cổ phiếu						
	Tổng cộng						
	TỔNG I + II						

C. BÁO CÁO VỀ VỊ THẾ MỞ VÀ GIÁ TRỊ HIỆN TẠI CỦA CÁC CHỨNG QUYỀN

STT	Tên chứng quyền	Mã chứng quyền	Loại chứng quyền (mua/bán)	Vị thế mở đầu kỳ tại	Giá trị tương ứng với vị thế mở đầu kỳ	Vị thế mở cuối kỳ tại ...	Giá đóng cửa phiên giao dịch cuối cùng của tháng (đồng)	Giá trị cuối kỳ (đồng)	Chênh lệch giữa giá trị cuối kỳ với giá trị đầu kỳ
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9) = (7)x(8)	(10) = (9) - (6)
1.									
2.									
....									
Tổng cộng									

Người đại diện theo pháp luật/Tổng Giám đốc
(Ký, ghi rõ họ tên, chức vụ, đóng dấu)



Phụ lục 03

**MẪU GIẤY ĐỀ NGHỊ TẠM NGỪNG HOẠT ĐỘNG
TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG**

(Ban hành kèm theo Quyết định số 165/QĐ-SGDHCM ngày 02 / 03 / 2018 của Tổng Giám đốc
Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh)

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

....., ngày..... tháng năm

**GIẤY ĐỀ NGHỊ TẠM NGỪNG HOẠT ĐỘNG TẠO LẬP
THỊ TRƯỜNG TẠI SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN TP.HCM**

Kính gửi: Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh.

Chúng tôi, Công ty chứng khoán.....Giấy phép thành
lập và hoạt động số.....

Là tổ chức phát hành chứng quyềntrong đợt phát hành ngày
tháng năm theo Giấy chứng nhận chào bán chứng quyền số.....

Chúng tôi đề nghị được tạm ngừng hoạt động tạo lập thị trường tại Sở Giao dịch
Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh kể từ ngày:...../...../..... đối với chứng
quyền....., mã chứng khoán:.....

Lý do:

.....
.....
.....

Chúng tôi xin cam đoan những lời khai trên đây là đúng sự thật và hoàn toàn chịu
trách nhiệm trước pháp luật về các nội dung trên.

Người đại diện theo pháp luật /Tổng giám đốc
(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)