

THÔNG BÁO ĐIỀU KHOẢN VÀ ĐIỀU KIỆN GIAO DỊCH HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI TRÁI PHIẾU CHÍNH PHỦ

- Căn cứ quy định tại Hợp đồng mở tài khoản giao dịch Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ giữa BSC và Khách hàng;
- Căn cứ Quy định của Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt Nam, quy định pháp luật hiện hành và quy định tại BSC;

BSC thông báo tới Khách hàng các điều kiện và điều khoản áp dụng đối với giao dịch Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ tại BSC hiện nay như sau:

1. **Tỷ lệ ký quỹ ban đầu:** 2.5% giá trị thanh toán mở vị thế

2. **Tài sản ký quỹ:** 100% bằng tiền.

3. **Giá trị tài sản hợp lệ:**

- Tại công ty: bao gồm toàn bộ tiền mặt và tiền ký quỹ sau khi trừ đi các khoản nghĩa vụ cần thanh toán.
- Tại CCP: là giá trị tiền đã nộp ký quỹ thành công trên CCP.

4. **Tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ:**

$$\text{Tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ} = \frac{\text{Giá trị ký quỹ duy trì yêu cầu}}{\text{Giá trị tài sản hợp lệ}}$$

❖ Các ngưỡng quản lý Tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ:

- An toàn: Khi tỷ lệ sử dụng ký quỹ vượt quá tỷ lệ an toàn, KH không mở thêm được vị thế mới.
- Cảnh báo 1: BSC gọi bổ sung ký quỹ để đưa tỷ lệ sử dụng ký quỹ về mức an toàn.
- Cảnh báo 2 : BSC gọi bổ sung ký quỹ để đưa tỷ lệ sử dụng ký quỹ về mức an toàn.
- Xử lý: BSC xử lý, tự động đóng vị thế hiện có của Khách hàng để đưa tỷ lệ sử dụng ký quỹ về mức an toàn.

❖ Quy định về quản lý Tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ tại BSC:

- An toàn: 70%



- Cảnh báo 1: 80%
- Cảnh báo 2: 90%
- Xử lý: 95%

5. Giới hạn vị thế:

- Khách hàng tổ chức là nhà đầu tư chứng khoán chuyên nghiệp: 10.000 hợp đồng
- Khách hàng tổ chức thông thường: 5.000 hợp đồng

6. Thanh toán và xử lý chậm thanh toán:

- ❖ Lãi/ lỗ vị thế hàng ngày: thanh toán trước 11h00 ngày làm việc tiếp theo ngày phát sinh.
- ❖ Phí giao dịch, thuế: thanh toán cuối ngày phát sinh, theo quy định pháp luật
- ❖ Xử lý chậm thanh toán: vào cuối ngày thanh toán, các khoản phải thanh toán nhưng chưa được Khách hàng thanh toán sẽ được coi là chậm thanh toán và xử lý thành khoản nợ thấu chi, tính lãi chậm trả bắt đầu từ ngày phát sinh dư nợ.
- ❖ Quy định về phí phạt chậm thanh toán tại BSC
 - *Lãi suất: 19.5%/năm*
 - *Phí phạt = Số tiền chưa thanh toán * Thời gian chậm thanh toán * Lãi suất phạt / 365 (trong đó, thời gian chậm thanh toán căn cứ theo số ngày thực tế chậm thanh toán, lãi suất phạt tối đa bằng 150% lãi suất cho vay ký quỹ chứng khoán BSC quy định tại thời điểm vi phạm).*

7. Thanh toán đáo hạn:

7.1. Chứng minh khả năng thanh toán:

- a. Đối với Khách hàng có vị thế mua, Khách hàng lựa chọn một trong hai hình thức chứng minh khả năng thanh toán như sau:
 - Sử dụng thư bảo lãnh: Trước 15h ngày giao dịch cuối cùng, Khách hàng có vị thế mua cung cấp Thư bảo lãnh (bản gốc/ bản fax/ bản scan) có hiệu lực ít nhất bốn (04) ngày làm việc kể từ ngày giao dịch cuối cùng cho BSC, trong đó nêu rõ cam kết thanh toán vô điều kiện, không hủy ngang cho VSD bất cứ khoản tiền nào trong giới hạn số tiền bảo lãnh, tương ứng với số tiền không thấp hơn giá trị hợp đồng tính theo mệnh giá trái phiếu.
 - Chuyển tiền: Trước 15h ngày giao dịch cuối cùng, Khách hàng chuyển toàn bộ số tiền không thấp hơn giá trị hợp đồng tính theo mệnh giá trái phiếu vào tài khoản của BSC



theo thông báo của BSC

b. Đối với Khách hàng có vị thế bán:

Trước 15h ngày giao dịch cuối cùng, Khách hàng cung cấp danh sách trái phiếu dự kiến được sử dụng để chuyển giao theo Phụ lục 01.

7.2. Kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ

a. Trước 11h ngày giao dịch cuối cùng, Khách hàng có nghĩa vụ duy trì kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu chính phủ. Khách hàng có vị thế mua nộp kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ bằng tiền. Khách hàng có vị thế bán nộp kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ bằng tiền hoặc trái phiếu trong danh sách trái phiếu chuyển giao.

b. Giá trị kỳ quỹ bằng tiền được xác định theo công thức sau:

$$DM = DM_{rate} * FSP * m * q$$

trong đó:

+ DM_{rate} : 5%

+ FSP: giá thanh toán cuối cùng của Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ

+ m: hệ số nhân hợp đồng

+ q: số Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ nộp kỳ quỹ đảm bảo thực hiện

c. Lưu ý: Trái phiếu nộp kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ là trái phiếu chuyển giao. Tương ứng với mỗi Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ, Khách hàng chỉ được nộp một (01) mã trái phiếu trong danh sách các trái phiếu có thể chuyển giao; số lượng trái phiếu nộp tương ứng 100% giá trị hợp đồng đó.

7.3. Trước 15h ngày làm việc thứ hai sau ngày giao dịch cuối cùng, Khách hàng có vị thế bán gửi BSC xác nhận danh sách trái phiếu chuyển giao (Phụ lục 02) và Bộ hồ sơ vay chứng khoán theo hướng dẫn của BSC (trong trường hợp vay trái phiếu để chuyển giao).

7.4. Trước 17h ngày làm việc thứ hai sau ngày giao dịch cuối cùng, BSC thông báo cho Khách hàng có vị thế mua trái phiếu nhận chuyển giao và nghĩa vụ thanh toán tiền thông qua một hoặc các hình thức đã quy định tại Hợp đồng mở tài khoản giao dịch chứng khoán phái sinh.

7.5. Trước 10h ngày thanh toán cuối cùng, Khách hàng có vị thế mua chuyển số tiền chênh lệch giữa nghĩa vụ thanh toán tiền đã được thông báo tại Điều 7.4 và số tiền đã chuyển để chứng minh khả năng thanh toán tại Điều 7.1 (nếu có) vào tài khoản mở tại BSC. Khách hàng có vị thế bán đã nộp kỳ quỹ đảm bảo thực hiện Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ bằng tiền chuyển toàn bộ số lượng trái phiếu theo đúng Văn bản xác nhận danh sách trái phiếu chuyển giao tại Điều 7.3 vào tài khoản mở tại BSC.

7.6. Các trường hợp chuyển sang hình thức thanh toán bằng tiền:



- (i) Nhà đầu tư không chứng minh được khả năng thanh toán trước 15h ngày giao dịch cuối cùng
- (ii) Nhà đầu tư có vị thế bán không gửi lại Xác nhận danh sách trái phiếu chuyển giao
- (iii) Các trường hợp mất khả năng thanh toán khác theo hướng dẫn của BSC

7.7. Xử lý các trường hợp chuyển sang hình thức thanh toán bằng tiền

Nhà đầu tư trong các trường hợp quy định tại Điều 7.6 thực hiện chuyển tiền bồi thường vào tài khoản tại BSC trước 10h ngày thanh toán cuối cùng. Giá trị bồi thường được tính theo công thức:

$$\text{Giá trị bồi thường} = 5\% * \text{FSP} * \text{Hệ số nhân hợp đồng} * \text{Số hợp đồng}$$

Trong đó:

FSP: Giá thanh toán cuối cùng

Hệ số nhân hợp đồng: 10,000

Bằng Thông báo này, Khách hàng có nghĩa vụ thực hiện và tuân thủ các điều kiện và điều khoản áp dụng đối với giao dịch chứng khoán phái sinh như quy định tại Thông báo của BSC theo từng thời kỳ.

Thông báo này có hiệu lực kể từ ngày 04/07/2019 và thay thế các thông báo áp dụng đối với giao dịch Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ tại BSC đã ban hành trước đây.

BSC được quyền sửa đổi, bổ sung các nội dung điều kiện và điều khoản theo Thông báo tại bất kỳ thời điểm nào theo quyết định của BSC và phù hợp quy định của cơ quan nhà nước có thẩm quyền.



TRÂN TRỌNG THÔNG BÁO!

PHỤ LỤC 01: DANH SÁCH TRÁI PHIẾU DỰ KIẾN CHUYỂN GIAO**NHÀ ĐẦU TƯ****CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM****Độc lập – Tự do – Hạnh phúc****THÔNG BÁO DANH SÁCH TRÁI PHIẾU CHUYỂN GIAO**

Tại ngày giao dịch cuối cùng: .../.../...

Kính gửi: CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN NGÂN HÀNG ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM

Chúng tôi xin gửi Quý Công Ty thông tin trái phiếu dự kiến chuyển giao để thực hiện thanh toán Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ như sau:

- Mã hợp đồng:
- Ngày thanh toán cuối cùng:

STT	Tên NĐT	Số TKLK	Trái phiếu trên TK CKKQ của NĐT tại BSC		Trái phiếu dự kiến mua, vay ¹	
			Mã TP	Số lượng	Mã TP	Số lượng

....., ngày ... tháng ... năm ...

NGƯỜI ĐẠI DIỆN THEO PHÁP LUẬT*(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)*

¹ Trái phiếu đặt lệnh mua, vay có thể khác trái phiếu dự kiến, tuy nhiên, phải thuộc danh sách trái phiếu có thể sử dụng để chuyển giao.



PHỤ LỤC 02: DANH SÁCH TRÁI PHIẾU DỰ KIẾN CHUYỂN GIAO

NHÀ ĐẦU TƯ

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập – Tự do – Hạnh phúc

XÁC NHẬN DANH SÁCH TRÁI PHIẾU CHUYỂN GIAO

Tại ngày E+2: .../.../...

Kính gửi: CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN NGÂN HÀNG ĐẦU TƯ VÀ PHÁT TRIỂN VIỆT NAM

Chúng tôi xin gửi Quý Công Ty danh sách trái phiếu chuyển giao để thực hiện thanh toán Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ như sau:

- Mã hợp đồng:
- Ngày thanh toán cuối cùng:

STT	Tên NĐT	Số TKLK	Trái phiếu trên TK CKKQ của NĐT tại BSC		Trái phiếu nhận về theo kết quả mua, vay	
			Mã TP	Số lượng	Mã TP	Số lượng

Chúng tôi cam kết sẽ chuyển khoản đủ và chính xác số lượng, mã trái phiếu đã xác nhận vào TK CKKQ tại BSC để thực hiện nghĩa vụ thanh toán theo đúng thời hạn quy định./.

....., ngày ... tháng ... năm ...

NGƯỜI ĐẠI DIỆN THEO PHÁP LUẬT

(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)