

## NHỮNG THAY ĐỔI NỔI BẬT ĐỐI VỚI GIAO DỊCH PHÁI SINH KHI TRIỂN KHAI KRX

NỘI DUNG	QUY ĐỊNH HIỆN TẠI	QUY ĐỊNH HT KRX
<b>Thay đổi Tên mã hợp đồng giao dịch</b>	<p>- Gồm 09 ký tự, dễ đọc nhưng biểu thị ít nhóm thông tin nên không hỗ trợ các sản phẩm, công cụ phái sinh phức tạp như Option, Spread.</p> <p>- Nguyên tắc:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○ Tài sản cơ sở (VN30/GB05)</li> <li>○ Loại sản phẩm (F)</li> <li>○ Thời gian đáo hạn (yyymm)</li> </ul>	<p>Gồm 09 ký tự nhưng biểu thị nhiều thông tin hơn về sản phẩm do đó hỗ trợ các sản phẩm, công cụ phái sinh phức tạp như Option, Spread...</p> <p>Nguyên tắc:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○ Loại chứng khoán (CKPS - 4)</li> <li>○ Nhóm CKPS (HĐTL -1) Nội dung thay đổi Tài sản cơ sở (VN30 - 11; GB05 - B5; GB10 - BA)</li> <li>○ Năm đáo hạn (2020 - A; 2021 - B;...; 2039-W)</li> <li>○ Tháng đáo hạn (01-1; 02-2; ...; 10 - A; 11- B; 12 - C) Định danh CKPS (HĐTL-000)</li> </ul> <p>Chú ý: Tên chỉ thay đổi với các hợp đồng niêm yết sau vận hành KRX</p>
<b>Thời điểm giao dịch phái sinh khi mở TK</b>	<p>Khi VSDC duyệt mở tài khoản thì Khách hàng được giao dịch vào ngày giao dịch tiếp theo</p>	<p>Khách hàng được giao dịch ngay sau khi VSDC duyệt mở tài khoản</p>
<b>Nguyên tắc ký quỹ</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Khách hàng cần nộp ký quỹ lên VSDC mới đặt được lệnh</li> <li>2. Tỷ lệ của tài khoản tính theo giá khớp lệnh của HĐTL trên thị trường phái sinh realtime trong phiên theo tài sản ký quỹ tại VSD</li> </ol>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Khách hàng đảm bảo đủ giá trị ký quỹ trên TKCKPS tại CTCK để thực hiện lệnh giao dịch</li> <li>2. Trong phiên giao dịch, tỷ lệ ký quỹ của tài khoản tính realtime theo tổng tài sản trên TKCKPS của Khách hàng (gồm tài sản tại CTCK và ký quỹ tại VSDC)</li> <li>3. Cuối ngày giao dịch (theo quy chế TTBT của VSD chậm nhất là 16h30), VSDC thực hiện:</li> </ol>

### TVS - Ha Noi

Harec Building, 4A Lang Ha, Ba Dinh District, Hanoi.  
 (+84) 24 3248 4820  
 www.tvs.vn

### TVS - Ho Chi Minh

Bitexco Nam Long Building, 63A Vo Van Tan, District 3, Ho Chi Minh.  
 (+84) 28 6299 2099  
 www.tvs.vn

NỘI DUNG	QUY ĐỊNH HIỆN TẠI	QUY ĐỊNH HT KRX
		<ul style="list-style-type: none"> <li>• Tính nghĩa vụ ký quỹ (MR) dựa vào số vị thế mở cuối ngày T và giá chỉ số tương ứng của thị trường cơ sở theo công thức COMS của hệ thống KRX</li> <li>• So sánh nghĩa vụ MR với tài sản đã nộp ký quỹ của từng tài khoản:               <ul style="list-style-type: none"> <li>○ Nếu TK đã nộp đủ ký quỹ (<math>MRM &lt; \text{hoặc} = \text{tài sản ký quỹ}</math>): VSDC không yêu cầu nộp thêm TSKQ;</li> <li>○ Nếu TK chưa nộp đủ ký quỹ (<math>MR &gt; \text{tài sản ký quỹ}</math>): VSDC yêu cầu nộp thêm TSKQ. Khách hàng cần nộp ký quỹ lên VSDC hoặc hệ thống TVS sẽ tự động nộp ký quỹ lên VSD để đảm bảo nghĩa vụ của TK vào đầu ngày T+1;</li> <li>○ VSDC yêu cầu duy trì tài sản ký quỹ đảm bảo nghĩa vụ MR tại ngày T đến cuối ngày T+1 (sẽ cập nhật theo giá trị ký quỹ MR của số dư vị thế cuối ngày T+1 của TK). Khách hàng muốn rút tiền ký quỹ từ VSDC khi đã đóng hết vị thế qua đêm tại ngày T thì phải đợi hết ngày <b>T+1</b> mới thực hiện được.</li> </ul> </li> </ul>
<p><b>Kiểm soát tỷ lệ ký quỹ</b></p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Kiểm soát tỷ lệ ký quỹ trong phiên giao dịch.</li> <li>• Thời gian xử lý từ ngày làm việc liền sau ngày vi phạm tỷ lệ ký quỹ (ngày T+1)</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• VSDC kiểm soát tỷ lệ ký quỹ theo giá đóng cửa cuối phiên giao dịch của các vị thế mở qua đêm tại ngày T.</li> <li>• Sau thời điểm 09h30 ngày T+1, các tài khoản vi phạm nghĩa vụ ký quỹ tại VSDC (tiền trên tài khoản ký quỹ của KH tại VSDC nhỏ hơn mức ký quỹ yêu cầu) VSD sẽ gửi điện thông báo cho SGD Hà Nội đề nghị tạm đình chỉ giao dịch với tài khoản vi phạm ( block tài khoản), gửi điện thông báo cho thành viên bù trừ yêu cầu không mở vị thế mới</li> </ul>

**TVS - Ha Noi**

📍 Harec Building, 4A Lang Ha, Ba Dinh District, Hanoi.  
☎ (+84) 24 3248 4820  
▪ www.tvsvn

**TVS - Ho Chi Minh**

📍 Bitexco Nam Long Building, 63A Vo Van Tan, District 3, Ho Chi Minh.  
☎ (+84) 28 6299 2099  
▪ www.tvsvn

NỘI DUNG	QUY ĐỊNH HIỆN TẠI	QUY ĐỊNH HT KRX
		<ul style="list-style-type: none"> <li>• Đến thời điểm 14h và chậm nhất 16h30 ngày T+1, VSDC sẽ kiểm tra nghĩa vụ ký quỹ của các tài khoản đang bị hạn chế giao dịch, nếu đã đảm bảo nghĩa vụ thì sẽ mở chặn hạn chế giao dịch (unblock).</li> <li>• Trường hợp tài khoản bị hạn chế giao dịch có nhu cầu đóng vị thế, CTCK sẽ thực hiện lệnh Closeout để thực hiện theo yêu cầu của Khách hàng.</li> </ul>
<b>Lệnh closeout</b>	Không có	<p>Được áp dụng trong các tình huống sau:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○ Tài khoản nhà đầu tư không nộp đủ ký quỹ bổ sung theo yêu cầu</li> <li>○ Đóng vị thế bắt buộc</li> </ul> <p>Nhà đầu tư không được tự đặt lệnh close out.</p> <p>Được phép hủy với những lệnh chưa được thực hiện hoặc phần còn lại của lệnh chưa được thực hiện.</p>
<b>Phí Quản lý vị thế (Phí thế vị)</b>	VSDC thu Phí Quản lý vị thế qua đêm (Phí QLVT): 2.550đ/ HĐ/ ngày/ Tài khoản/ ngày	<p>VSD thu phí bù trừ vị thế: <b>2.550đ/ HĐ</b> giao dịch khớp lệnh (tương tự như phí giao dịch trả sở GD)</p> <p>Ví dụ: Đầu ngày T, Khách hàng không có số dư, trong ngày Long 50, Short 40 =&gt; số dư mở qua ngày là 10 HĐ., KH giữ số dư này 3 ngày rồi ngày T4 thì đóng hết các vị thế</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>○ <b>CŨ:</b> Phí quản lý vị thế trả VDSC tính theo số dư vị thế qua đêm là 10 HĐ x 3 ngày x Phí QLVT = 30 HĐ x Phí QLVT</li> <li>○ <b>MỚI:</b> VSD tính phí bù trừ CKPS: Ngày 1: Long 50 + Short 40 = 90 HĐ Ngày 4: Short 10 = 10 HĐ =&gt; Tổng số HĐ tính phí bù trừ CKPS là 100 HĐ =&gt; Tổng phí bù trừ CKPS của TK là 100 HĐ x Phí bù trừ vị thế CKPS</li> </ul>

**TVS - Ha Noi**

📍 Harec Building, 4A Lang Ha, Ba Dinh District, Hanoi.  
☎ (+84) 24 3248 4820  
▪ www.tvs.vn

**TVS - Ho Chi Minh**

📍 Bitexco Nam Long Building, 63A Vo Van Tan, District 3, Ho Chi Minh.  
☎ (+84) 28 6299 2099  
▪ www.tvs.vn