

**SỞ GIAO DỊCH
CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM**

Số: 74 /QĐ-SGDVN

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

Hà Nội, ngày 07 tháng 6 năm 2022

QUYẾT ĐỊNH

Ban hành mẫu Hợp đồng tương lai

TỔNG GIÁM ĐỐC

SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM



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

Căn cứ Nghị định số 158/2020/NĐ-CP ngày 31 tháng 12 năm 2020 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh;

Căn cứ Quyết định số 37/2020/QĐ-TTg ngày 23 tháng 12 năm 2020 của Thủ tướng Chính phủ về thành lập, tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Quyết định số 757/QĐ-BTC ngày 01 tháng 4 năm 2021 của Bộ trưởng Bộ Tài chính ban hành Điều lệ tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Công văn số 3444/UBCK-PTTT ngày 06 tháng 6 năm 2022 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc chấp thuận mẫu Hợp đồng tương lai chỉ số cổ phiếu VN30, mẫu Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 5 năm, mẫu Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm;

Căn cứ Quy chế Niêm yết và giao dịch hợp đồng tương lai ban hành theo Quyết định số 20/QĐ-HĐTV ngày 20 tháng 5 năm 2022 của Hội đồng thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;

Theo đề nghị của Trưởng ban Chiến lược và Phát triển,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này mẫu Hợp đồng tương lai chỉ số cổ phiếu VN30, mẫu Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 5 năm, mẫu Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm.

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

Điều 3. Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội, Thủ trưởng các đơn vị thuộc Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam, các tổ chức và cá nhân có liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. /.

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN (đề b/c);
- HĐTV (đề b/c);
- VSD (đề p/h);
- Lưu VT, CLPT (15b).



Phạm Văn Hoàng



MẪU HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI CHỈ SỐ CỔ PHIẾU VN30

TT	Điều khoản	Mô tả
1	Tên hợp đồng	Hợp đồng tương lai trên chỉ số VN30
2	Mã giao dịch	Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội thực hiện cấp mã giao dịch hợp đồng tương lai đảm bảo cấu trúc mã giao dịch theo quy định của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam
3	Tài sản cơ sở	Chỉ số VN30
4	Quy mô hợp đồng	100.000 đồng × điểm chỉ số VN30
5	Hệ số nhân hợp đồng	100.000 đồng
6	Ngày niêm yết	10/8/2017
7	Phương thức giao dịch	Phương thức khớp lệnh và Phương thức thỏa thuận
8	Tháng đáo hạn	Tháng hiện tại, tháng kế tiếp, hai tháng cuối 02 quý tiếp theo. Ví dụ: tháng hiện tại là tháng 4. Các tháng đáo hạn là tháng 4, tháng 5, tháng 6 và tháng 9
9	Thời gian giao dịch	Mở cửa trước thị trường cơ sở 15 phút Đóng cửa: cùng thị trường cơ sở
10	Bước giá /Đơn vị yết giá	0,1 điểm chỉ số
11	Đơn vị giao dịch	1 hợp đồng
12	Giá tham chiếu	Giá thanh toán cuối ngày của ngày giao dịch liền trước hoặc giá lý thuyết
13	Biên độ dao động	+/-7% so với giá tham chiếu
14	Giới hạn lệnh	500 hợp đồng/lệnh
15	Giới hạn vị thế	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
16	Ngày giao dịch cuối cùng	Ngày Thứ Năm thứ ba trong tháng đáo hạn, trường hợp trùng ngày nghỉ sẽ được điều chỉnh lên ngày giao dịch liền trước đó
17	Ngày thanh toán cuối cùng	Ngày làm việc liền sau ngày giao dịch cuối cùng
18	Phương thức thanh toán	Thanh toán bằng tiền
19	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối ngày	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam

07
 Ờ
 Ờ DỊC
 Ờ KH
 Ờ NA
 Ờ 1

TT	Điều khoản	Mô tả
20	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối cùng	Là giá trị trung bình số học giản đơn của chỉ số trong 30 phút cuối cùng của ngày giao dịch cuối cùng (bao gồm 15 phút khớp lệnh liên tục và 15 phút khớp lệnh định kỳ đóng cửa), sau khi loại trừ 3 giá trị chỉ số cao nhất và 3 giá trị chỉ số thấp nhất của phiên khớp lệnh liên tục
21	Mức ký quỹ	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
22	Giá dịch vụ	Thu tiền cung cấp dịch vụ theo quy định của Bộ Tài chính

MẪU HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI TRÁI PHIẾU CHÍNH PHỦ KỶ HẠN 5 NĂM

TT	Điều khoản	Mô tả
1	Tên hợp đồng	Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 5 năm
2	Mã giao dịch	Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội thực hiện cấp mã giao dịch hợp đồng tương lai đảm bảo cấu trúc mã giao dịch theo quy định của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam
3	Tài sản cơ sở	Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 5 năm, mệnh giá 100.000 đồng, lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm, trả lãi định kỳ cuối kỳ 12 tháng/lần, trả gốc một lần khi đáo hạn
4	Quy mô hợp đồng	1 tỷ đồng
5	Hệ số nhân hợp đồng	10.000
6	Ngày niêm yết	04/7/2019
7	Phương thức giao dịch	Phương thức khớp lệnh và Phương thức thỏa thuận
8	Tháng đáo hạn	03 tháng cuối 03 Quý gần nhất
9	Thời gian giao dịch	Mở cửa: sớm hơn thị trường cơ sở 15 phút Đóng cửa: cùng giờ thị trường cơ sở
10	Bước giá/ đơn vị yết giá	1 đồng
11	Đơn vị giao dịch	1 hợp đồng
12	Giá tham chiếu	Giá thanh toán cuối ngày của ngày giao dịch liền trước hoặc giá lý thuyết (trong ngày giao dịch đầu tiên)
13	Biên độ dao động	+/-3% so với giá tham chiếu
14	Giới hạn lệnh	500 hợp đồng/lệnh
15	Giới hạn vị thế	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
16	Ngày giao dịch cuối cùng	Ngày 15 của tháng đáo hạn hoặc ngày giao dịch liền trước nếu ngày 15 là ngày nghỉ
17	Ngày thanh toán cuối cùng	Ngày làm việc thứ ba kể từ ngày giao dịch cuối cùng
18	Phương thức thanh toán	Chuyển giao tài sản cơ sở
19	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối ngày	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
20	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối cùng	Giá thanh toán cuối ngày tại ngày giao dịch cuối cùng

H
A
N

TT	Điều khoản	Mô tả
21	Tiêu chuẩn trái phiếu giao hàng	Trái phiếu Chính phủ do Kho bạc Nhà nước phát hành, có kỳ hạn còn lại từ 3 năm đến 7 năm tính đến ngày thanh toán cuối cùng, có giá trị niêm yết tối thiểu 2.000 tỷ đồng. Hệ số chuyển đổi được tính theo lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm.
22	Mức ký quỹ	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam

MẪU HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI TRÁI PHIẾU CHÍNH PHỦ KỶ HẠN 10 NĂM

TT	Điều khoản	Mô tả
1	Tên hợp đồng	Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm
2	Mã giao dịch	Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội thực hiện cấp mã giao dịch hợp đồng tương lai đảm bảo cấu trúc mã giao dịch theo quy định của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam
3	Tài sản cơ sở	Trái phiếu Chính phủ kỳ hạn 10 năm, mệnh giá 100.000 đồng, lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm, trả lãi định kỳ cuối kỳ 12 tháng/lần, trả gốc một lần khi đáo hạn
4	Quy mô hợp đồng	1 tỷ đồng
5	Hệ số nhân hợp đồng	10.000
6	Ngày niêm yết	28/6/2021
7	Phương thức giao dịch	Phương thức khớp lệnh và Phương thức thỏa thuận
8	Tháng đáo hạn	03 tháng cuối 03 Quý gần nhất
9	Thời gian giao dịch	Mở cửa: sớm hơn thị trường cơ sở 15 phút Đóng cửa: cùng giờ thị trường cơ sở
10	Bước giá/ đơn vị yết giá	1 đồng
11	Đơn vị giao dịch	1 hợp đồng
12	Giá tham chiếu	Giá thanh toán cuối ngày của ngày giao dịch liền trước hoặc giá lý thuyết (trong ngày giao dịch đầu tiên)
13	Biên độ dao động	+/-3% so với giá tham chiếu
14	Giới hạn lệnh	500 hợp đồng/lệnh
15	Giới hạn vị thế	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
16	Ngày giao dịch cuối cùng	Ngày 25 của tháng đáo hạn hoặc ngày giao dịch liền trước nếu ngày 25 là ngày nghỉ
17	Ngày thanh toán cuối cùng	Ngày làm việc thứ ba kể từ ngày giao dịch cuối cùng
18	Phương thức thanh toán	Chuyển giao tài sản cơ sở
19	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối ngày	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam
20	Phương pháp xác định giá thanh toán cuối cùng	Giá thanh toán cuối ngày tại ngày giao dịch cuối cùng



TT	Điều khoản	Mô tả
21	Tiêu chuẩn trái phiếu giao hàng	Trái phiếu Chính phủ do Kho bạc Nhà nước phát hành trả lãi định kỳ cuối kỳ 12 tháng/lần, và có các kỳ trả lãi bằng nhau, trả gốc một lần khi đáo hạn, có kỳ hạn còn lại từ 8 năm đến 11 năm tính đến ngày thanh toán cuối cùng, có giá trị niêm yết tối thiểu 2.000 tỷ đồng. Hệ số chuyển đổi được tính theo lãi suất danh nghĩa 5,0%/năm.
22	Mức ký quỹ	Theo quy định của Trung tâm Lưu ký Chứng khoán Việt Nam