

Số: **796**/QĐ-SGDHN

Hà Nội, ngày **27** tháng **11** năm 2019

QUYẾT ĐỊNH

Về việc sửa đổi, bổ sung một số điều của Quy chế niêm yết và giao dịch hợp đồng tương lai tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội ban hành kèm theo Quyết định số 189/QĐ-SGDHN ngày 24/3/2017 của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội

**TỔNG GIÁM ĐỐC
SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN HÀ NỘI**

Căn cứ Quyết định số 01/2009/QĐ-TTg ngày 02/01/2009 của Thủ tướng Chính phủ về việc thành lập Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội;

Căn cứ Điều lệ Tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội ban hành kèm theo Quyết định số 2398/QĐ-BTC ngày 21/11/2017 của Bộ trưởng Bộ Tài chính;

Căn cứ Luật Chứng khoán số 70/2006/QH11 ngày 29/6/2006 và Luật số 62/2010/QH12 ngày 24/11/2010 sửa đổi, bổ sung một số điều của Luật Chứng khoán;

Căn cứ Nghị định số 58/2012/NĐ-CP ngày 20/7/2012 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; Nghị định số 60/2015/NĐ-CP ngày 26/6/2015 của Chính phủ sửa đổi, bổ sung một số điều của Nghị định số 58/2012/NĐ-CP;

Căn cứ Nghị định số 42/2015/NĐ-CP ngày 05/5/2015 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh;

Căn cứ Thông tư số 11/2016/TT-BTC ngày 19/01/2016 của Bộ Tài chính hướng dẫn một số điều của Nghị định số 42/2015/NĐ-CP ngày 05/5/2015 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh và Thông tư số 23/2017/TT-BTC ngày 16/3/2017 sửa đổi, bổ sung một số điều của Thông tư số 11/2016/TT-BTC ngày 19/01/2016;

Căn cứ Thông tư số 155/2015/TT-BTC ngày 06/10/2015 của Bộ Tài chính về việc công bố thông tin trên thị trường chứng khoán;

Căn cứ Nghị quyết số 232/NQ-HĐQT ngày 30/9/2019 của Hội đồng Quản trị Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội;

Căn cứ Công văn số 6870/UBCK-PTTT ngày 13/11/2019 của Chủ tịch Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc phê duyệt nội dung Quyết định sửa đổi, bổ sung một số điều của Quy chế niêm yết và giao dịch hợp đồng tương lai tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội ban hành kèm theo Quyết định số 189/QĐ-SGDHN ngày 24/3/2017 của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội;



Theo đề nghị của Giám đốc phòng Thị trường Chứng khoán phái sinh,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Sửa đổi, bổ sung một số điều của Quy chế niêm yết và giao dịch hợp đồng tương lai tại Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội ban hành kèm theo Quyết định số 189/QĐ-SGDHN ngày 24/3/2017 của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội như sau:

1. Sửa đổi Khoản 14 và Khoản 33 Điều 3 như sau:

a) Sửa đổi Khoản 14 như sau:

“Danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao: là danh mục các trái phiếu chuyển giao do SGDCK công bố theo quy định tại Khoản 2 Điều 45 Quy chế này.”

b) Sửa đổi Khoản 33 như sau:

“Trái phiếu chuyển giao: là trái phiếu Chính phủ đáp ứng điều kiện và được đưa vào danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao.”

2. Sửa đổi Điều 20 như sau:

“Giới hạn vị thế của hợp đồng tương lai do TTLKCK quy định. SGDCK phối hợp với TTLKCK công bố giới hạn vị thế theo quy định tại điểm b khoản 3 Điều 27 Thông tư số 11/2016/TT-BTC.”

3. Sửa đổi Điều 45 như sau:

“1. Trái phiếu được sử dụng để chuyển giao vào ngày thanh toán cuối cùng của HĐTL TPCP là TPCP do KBNN phát hành và đáp ứng các điều kiện cụ thể sau:

a) Là trái phiếu mệnh giá một trăm nghìn (100.000) đồng, lãi suất danh nghĩa cố định, thanh toán lãi định kỳ vào cuối kỳ mười hai (12) tháng một lần, các kỳ trả lãi bằng nhau, thanh toán gốc một lần khi đáo hạn;

b) Đáp ứng điều kiện về giá trị niêm yết tối thiểu, điều kiện về kỳ hạn còn lại tính tại ngày thanh toán cuối cùng và các điều kiện khác (nếu có) quy định tại mẫu HĐTL TPCP.

2. SGDCK công bố thông tin về danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao khi niêm yết hợp đồng mới kèm theo hệ số chuyển đổi tương ứng với từng mã trái phiếu trong danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao. Thời điểm công bố danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao là ba (03) ngày giao dịch trước ngày giao dịch đầu tiên của hợp đồng. SGDCK thực hiện chốt danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao đối với các mã hợp đồng tối thiểu ba mươi (30) ngày trước ngày giao dịch cuối cùng. Sau thời điểm chốt danh sách, SGDCK và TTLKCK không cập nhật vào danh sách bất kỳ mã trái phiếu nào khác, kể cả khi đáp ứng điều kiện chuyển giao hoặc sử dụng để xác định giá thanh toán cuối cùng. Danh sách trái phiếu đủ điều kiện chuyển giao được cập nhật hàng ngày các mã trái phiếu đáp ứng đầy đủ các điều kiện nêu ở Khoản 1 Điều này cho đến ngày chốt danh sách”

4. Sửa đổi, bổ sung Phụ lục 01 về công thức tính hệ số chuyển đổi như sau:

(1) Nếu ngày thanh toán cuối cùng của hợp đồng là ngày giao dịch hưởng quyền của trái phiếu chuyển giao

$$CF = \frac{\frac{L_c}{k} + \frac{L_c}{r} \left(1 - \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^n} \right) + \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^n}}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^{\frac{D_n}{E}}} - (L_c/k) \times (E - D_n)/E$$

(2) Nếu ngày thanh toán cuối cùng của hợp đồng là ngày giao dịch không hưởng quyền của trái phiếu chuyển giao

$$CF = \frac{\frac{L_c}{r} \left(1 - \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^n} \right) + \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^n}}{\left(1 + \frac{r}{k} \right)^{\frac{D_n}{E}}} - (L_c/k) \times (-D_n/E)$$

Trong đó:

CF là hệ số chuyển đổi cho trái phiếu chuyển giao

L_c là lãi suất danh nghĩa (%/năm) của trái phiếu chuyển giao

r là lãi suất danh nghĩa (%/năm) của trái phiếu giả định

k là số lần trả lãi trong mỗi năm của trái phiếu chuyển giao

n là số kỳ trả lãi còn lại từ sau ngày trả lãi kế tiếp ngày thanh toán cuối cùng của hợp đồng cho đến khi trái phiếu đáo hạn

E là số ngày thực tế của kỳ trả lãi có chứa ngày thanh toán cuối cùng của hợp đồng

D_n là số ngày thực tế từ ngày thanh toán cuối cùng của hợp đồng đến ngày trả lãi kế tiếp

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

Điều 3. Giám đốc phòng Tổng hợp Pháp chế, Thủ trưởng các đơn vị thuộc Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội, các tổ chức và cá nhân liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. /th

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN (để b/c);
- TTLCK;
- Các CTCK, NHTM thành viên;
- HĐQT, BDH (để b/c);
- Lưu: VT, TTCKPS.

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



Nguyễn Như Quỳnh

