

THÔNG SỐ QUẢN LÝ HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI
Hiệu lực từ ngày 04 tháng 11 năm 2024

Số: V01

I. Bộ tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ ban đầu:

Nội dung	HĐTL chỉ số		HĐTL TPCP	
	TCSC	VSDC	TCSC	VSDC
Tỷ lệ ký quỹ ban đầu	17%	17%	2,5%	2,5%
Tỷ lệ ký quỹ ban đầu bảo đảm thực hiện hợp đồng	Không áp dụng	Không áp dụng	5%	5%

II. Bộ tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ duy trì:

Nội dung	Tại TCSC	Tại VSDC
Tỷ lệ an toàn	75%	75%
Tỷ lệ cảnh báo	80%	80%
Tỷ lệ xử lý	90%	90%
Tỷ lệ tạm đình chỉ giao dịch	Không áp dụng	100%

III. Quy định về quản lý Tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ:

TT	Trạng thái TK	Tỷ lệ sử dụng TKGD (tại TCSC)	Tỷ lệ sử dụng TTKQ (tại VSDC)	Ghi chú
1	An toàn	Tỷ lệ sử dụng TKGD $\leq 75\%$	Tỷ lệ sử dụng TTKQ $\leq 75\%$	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Khách hàng được mở mới vị thế khi Tỷ lệ sử dụng TKGD và Tỷ lệ sử dụng TTKQ tại cả hai tầng TCSC và VSDC không lớn hơn Tỷ lệ an toàn được thiết lập. ✓ Khách hàng được phép rút tiền ký quỹ khi Tỷ lệ sử dụng TTKQ tại tầng VSDC không lớn hơn Tỷ lệ an toàn tầng VSDC và được phép rút tiền ra ngân hàng khi Tỷ lệ sử dụng TKGD tại tầng TCSC không lớn hơn Tỷ lệ an toàn tầng TCSC.
2	Cảnh báo	$80\% \leq$ Tỷ lệ sử dụng TKGD $< 90\%$	$80\% \leq$ Tỷ lệ sử dụng TTKQ $< 90\%$	<ul style="list-style-type: none"> ✓ Khi Tỷ lệ sử dụng TK tại một trong hai tầng hoặc cả hai tầng tại TCSC và VSDC vi phạm tỷ lệ cảnh báo, Khách hàng cần bổ sung tài sản ký quỹ hoặc đóng vị thế để đưa tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ về <u>tỷ lệ an toàn</u>. ✓ TCSC sẽ gửi cảnh báo tới Khách hàng bằng SMS/Email/Noti: Sau khi chạy kết thúc cuối ngày: Gửi thông báo "Thông báo vi phạm tỷ lệ cảnh báo".



3	Xử lý	Tỷ lệ sử dụng TKGD >=90%	Tỷ lệ sử dụng TKKQ >=90%	<p>✓ Trong phiên giao dịch (từ 8h45 đến 14h45), khi Tỷ lệ sử dụng TK tại một trong hai tầng hoặc cả hai tầng tại TCSC và VSDC vi phạm tỷ lệ xử lý, TCSC sẽ gửi cảnh báo tới Khách hàng bằng SMS/Email/Noti: "<i>Thông báo vi phạm tỷ lệ xử lý</i>". Đồng thời, TCSC sẽ thực hiện đóng một phần hoặc toàn bộ vị thế của tài khoản để đưa tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ về <u>tỷ lệ an toàn</u>.</p> <p><u>Lưu ý:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ Nếu tài khoản vi phạm tỷ lệ xử lý tại cả hai tầng, TCSC sẽ xử lý theo Tỷ lệ sử dụng TK tại tầng nào vi phạm nặng hơn (tỷ lệ cao hơn). ▪ Nếu tài khoản có nhiều mã hợp đồng, TCSC ưu tiên đóng mã hợp đồng gần đến hạn nhất.
4	Vi phạm tỷ lệ tạm đình chỉ giao dịch	Không áp dụng	Tỷ lệ sử dụng TKKQ >=100%	<p>✓ Khi tỷ lệ sử dụng TKKQ tại tầng VSDC vi phạm tỷ lệ tạm đình chỉ giao dịch, tài khoản sẽ bị ngừng giao dịch bởi HNX. Khách hàng cần bổ sung tài sản ký quỹ kịp thời để đưa tài khoản thoát ngưỡng tỷ lệ xử lý VSDC, khi ấy tùy vào tỷ lệ sử dụng TKKQ, TCSC sẽ áp dụng quy định tương ứng.</p> <p>✓ Trường hợp khách hàng không bổ sung tài sản ký quỹ, TCSC sẽ thực hiện đóng xử lý để đưa tỷ lệ sử dụng tài sản ký quỹ về <u>tỷ lệ an toàn</u>.</p>

IV. Giới hạn vị thế tối đa:

Nội dung	HĐTL chỉ số	HĐTL TPCP 5 năm	HĐTL TPCP 10 năm
Khách hàng cá nhân	5.000 hợp đồng	Không áp dụng	Không áp dụng
Khách hàng tổ chức	10.000 hợp đồng	5.000 hợp đồng	5.000 hợp đồng
Nhà đầu tư chuyên nghiệp			
<ul style="list-style-type: none"> • Cá nhân • Tổ chức 	20.000 hợp đồng	10.000 hợp đồng	3.000 hợp đồng 10.000 hợp đồng

Ghi chú:

TCSC sẽ bảo lưu quyền thay đổi các thông số trên mà không cần phải thông báo trước cho khách hàng.

Tp.HCM, ngày 28 tháng 10 năm 2024

PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC



TRỊNH TẤN LỰC