

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

....., ngày tháng năm

THUYẾT MINH
ĐÁP ỨNG YÊU CẦU VỀ QUY TRÌNH NGHIỆP VỤ
(Phục vụ hoạt động bù trừ, thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh)

I. THÔNG TIN CHUNG

1. Tên tổ chức:
2. Trụ sở chính:
3. Điện thoại: Fax
4. Loại thành viên bù trừ đăng ký:.....
5. Danh sách thành viên Ban giám đốc được phân công phụ trách nghiệp vụ bù trừ và thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh (theo Phụ lục đính kèm).

II. THUYẾT MINH VỀ QUY TRÌNH NGHIỆP VỤ

Thuyết minh các quy trình xử lý nghiệp vụ bù trừ và thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh giữa thành viên bù trừ và VSDC (trình tự, thời gian, cách thức xử lý) như sau:

A. Đăng ký, hủy đăng ký thông tin tài khoản chứng khoán ký quỹ

1. Đăng ký thông tin tài khoản
 - a. Đối với tài khoản thông thường (netted):
 - Đăng ký thông tin tài khoản chứng khoán ký quỹ trong trường hợp nhà đầu tư đã có tài khoản giao dịch tại thành viên bù trừ.
 - Đăng ký thông tin tài khoản chứng khoán ký quỹ trong trường hợp nhà đầu tư chưa có hoặc không sử dụng tài khoản giao dịch tại thành viên bù trừ.
 - b. Đối với tài khoản tổng (omnibus account):
 - Quy trình xử lý hồ sơ.
 - Quy trình xử lý trên hệ thống.
2. Hủy đăng ký thông tin tài khoản
 - Quy trình xử lý vị thế, ký quỹ, hoàn tất nghĩa vụ thanh toán lỗ/lãi vị thế, thanh toán thực hiện hợp đồng (nếu có) trước khi gửi điện hủy đăng ký thông tin tài khoản.
 - Quy trình gửi điện hủy đăng ký thông tin tài khoản.

B. Nộp rút ký quỹ, phân bổ lãi tiền gửi ký quỹ

1. Nộp, rút ký quỹ
 - Quy trình nộp ký quỹ, xử lý điện nộp thành công, điện nộp bị lỗi (sau khi nhận được điện/thông báo xác nhận của VSDC).

- Quy trình rút ký quỹ: cách thức kiểm tra, đối chiếu số dư để xác định điện rút hợp lệ; cách thức xử lý điện rút thành công, điện rút bị từ chối (sau khi nhận được điện/thông báo xác nhận của VSDC).

- Thời gian xử lý điện nộp, rút trong ngày.

2. Phân bổ lãi tiền gửi trên tài khoản ký quỹ nhận được.

C. Bù trừ và thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh

1. Nhận thông báo thế vị.

2. Thực hiện sửa lỗi sau giao dịch.

3. Nhận thông tin giá thanh toán cuối ngày (DSP), giá thanh toán cuối cùng (FSP), tính toán, đối chiếu và xác nhận giá trị lỗ/lãi vị thế với VSDC.

4. Thực hiện thanh toán lỗ/lãi vị thế hàng ngày:

- Thông báo lỗ vị thế cho từng nhà đầu tư, nộp lỗ vị thế theo quy định.

- Thông báo lãi vị thế cho từng nhà đầu tư, phân bổ lãi vị thế cho nhà đầu tư sau khi nhận được.

5. Thanh toán thực hiện Hợp đồng tương lai trái phiếu Chính phủ.

- Các công việc xử lý từ ngày giao dịch cuối cùng (E) đến hết ngày thanh toán cuối cùng (E+3).

- Cách thức phân bổ tiền, trái phiếu Chính phủ cho nhà đầu tư sau khi VSDC, ngân hàng thanh toán hoàn tất thanh toán.

6. Xử lý mất khả năng thanh toán.

D. Quản lý mức ký quỹ yêu cầu, giới hạn vị thế

1. Tiếp nhận thông tin mức ký quỹ yêu cầu của VSDC và cách thức xử lý đối với tài khoản có giá trị tài sản ký quỹ thấp hơn mức ký quỹ yêu cầu của VSDC.

2. Tiếp nhận, xử lý thông tin vi phạm giới hạn vị thế các ngưỡng cảnh báo 1, 2, 3.

3. Cách thức xử lý trong trường hợp tài khoản giao dịch của nhà đầu tư bị khóa do không đảm bảo mức ký quỹ yêu cầu, vi phạm giới hạn vị thế.

E. Đối chiếu thông tin vị thế, tài khoản ký quỹ với VSDC

1. Cách thức, thời gian đối chiếu.

2. Xử lý trường hợp sai lệch thông tin.

(Lưu ý: Chỉ thể hiện các nội dung thuộc quy trình tương tác giữa TVBT và VSDC)

Chúng tôi cam kết các quy trình nghiệp vụ xây dựng tại đơn vị là hoàn toàn phù hợp, đáp ứng yêu cầu và tuân thủ đúng quy định của pháp luật, quy chế của Tổng công ty Lưu ký và Bù trừ chứng khoán Việt Nam.

NGƯỜI ĐẠI DIỆN PHÁP LUẬT

(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)

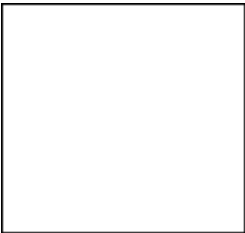
(Ban hành kèm theo Quy chế thành viên bù trừ chứng khoán phái sinh)

Mẫu 01/PS-TVBT

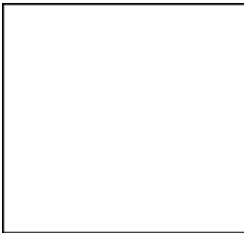
PHỤ LỤC
Danh sách thành viên Ban Giám đốc phụ trách
ng nghiệp vụ bù trừ và thanh toán giao dịch chứng khoán phái sinh
(Đính kèm Mẫu 01/PS-TVBT)

STT	Họ và tên	Số CMND hoặc CCCD hoặc Hộ chiếu	Vị trí công tác	Mẫu chữ ký 1	Mẫu chữ ký 2
1					
2					
...					

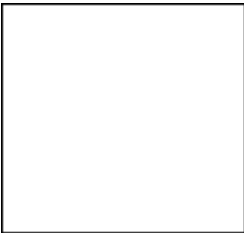
Mẫu dấu 1



Mẫu dấu 2



Mẫu dấu 3



Chúng tôi cam kết và chịu trách nhiệm hoàn toàn về tính chính xác, trung thực của những thông tin nêu trên.