

PHỤ LỤC SỐ VII

**MẪU BÁO CÁO PHÒNG NGỪA RỦI RO VÀ SỐ LƯỢNG CHỨNG QUYỀN CÓ
BẢO ĐẢM PHÁT HÀNH HÀNG NGÀY**

*(Kèm theo Thông tư số 122/2025/TT-BTC ngày 22 tháng 12 năm 2025 của Bộ trưởng Bộ
Tài chính)*

TỔ CHỨC PHÁT HÀNH

**CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT
NAM**

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Số:../.....

....., ngày ... tháng ... năm 20....

BÁO CÁO

Phòng ngừa rủi ro và số lượng chứng quyền có bảo đảm phát hành

Ngày/...../.....

Kính gửi: - Ủy ban Chứng khoán Nhà nước
- Sở giao dịch chứng khoán

Tên Tổ chức phát hành:

Tên giao dịch:.....

Trụ sở chính:

Điện thoại:.....

1. Số lượng chứng quyền có bảo đảm phát hành

STT	Mã chứng quyền	Nội dung (chi tiết theo từng mã chứng quyền)	Số lượng
1	Mã chứng quyền 1		
		1. Số lượng chứng quyền có bảo đảm được phép phát hành	
		2. Số lượng chứng quyền có bảo đảm đã bán ròng trong ngày	
		3. Tổng số lượng chứng quyền có bảo đảm đã bán ròng (số lượng chứng quyền có bảo đảm có bảo đảm đang lưu hành)	
		4. Số lượng chứng quyền có bảo đảm còn được phép bán (1-3)	

2	Mã chứng quyền 2		
		1. Số lượng chứng quyền có bảo đảm được phép phát hành	
		2. Số lượng chứng quyền có bảo đảm đã bán ròng trong ngày	
		3. Tổng số lượng chứng quyền có bảo đảm đã bán ròng (số lượng chứng quyền có bảo đảm có bảo đảm đang lưu hành)	
		4. Số lượng chứng quyền có bảo đảm còn được phép bán (1-3)	
	...		

2. Báo cáo hoạt động phòng ngừa rủi ro

a) Vị thế phòng ngừa rủi ro cho các chứng quyền có bảo đảm

Ngày	Mã chứng quyền	Vị thế phòng ngừa rủi ro lý thuyết	Vị thế phòng ngừa rủi ro thực tế	Chênh lệch	Số dư tiền tài khoản tự doanh cho hoạt động chứng quyền

b) Giao dịch chứng khoán cơ sở

STT	Mã cổ phiếu cơ sở	Số lượng cổ phiếu dư đầu ngày	Số lượng cổ phiếu giao dịch trong ngày		Số lượng cổ phiếu cuối ngày	Tỷ lệ nắm giữ/cổ phiếu lưu hành
			Mua	Bán		
		(1)	(2)	(3)	(4) = (1)+(2)-(3)	
1						
2						

Tài liệu gửi kèm: (nếu có)

....., ngày..... tháng..... năm

NGƯỜI ĐẠI DIỆN THEO PHÁP LUẬT

(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)