

Số: 53 /QĐ-SGDVN

Hà Nội, ngày 30 tháng 9 năm 2024

QUYẾT ĐỊNH
Về việc ban hành Quy chế
tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh

TỔNG GIÁM ĐỐC
SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM

Căn cứ Luật Chứng khoán ngày 26/11/2019;

Căn cứ Nghị định số 158/2020/NĐ-CP ngày 31/12/2020 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 23/12/2020 của Thủ tướng Chính phủ về việc thành lập, tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Thông tư số 58/2021/TT-BTC ngày 12/7/2021 của Bộ trưởng Bộ Tài chính hướng dẫn một số điều của Nghị định số 158/2020/NĐ-CP ngày 31/12/2020 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh;

Căn cứ Quyết định số 757/QĐ-BTC ngày 01/4/2021 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 5329/UBCK-PTTT ngày 21/8/2024 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc chấp thuận Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh;

Căn cứ Nghị quyết số 20/NQ-HĐTV ngày 17/9/2024 của Hội đồng Thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam về việc phê duyệt Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh;

Theo đề nghị của Trưởng ban Quản lý thành viên,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh.

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

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

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN;
- HĐTV;
- SGDHCM;
- VSDC;
- Các thành viên;
- Lưu: VT, QLTV (b).



QUY CHẾ

Tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh

(Ban hành kèm theo Quyết định số 53/QĐ-SGDVN ngày 30 tháng 9 năm 2024
của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam)

Chương I

QUY ĐỊNH CHUNG

Điều 1. Phạm vi điều chỉnh, đối tượng áp dụng

1. Phạm vi điều chỉnh

Quy chế này quy định về đăng ký, hoạt động, xử lý vi phạm của thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam.

2. Đối tượng áp dụng

- Thành viên giao dịch, thành viên giao dịch đặc biệt đăng ký làm thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh;
- Thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh;
- Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam và Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội;
- Các tổ chức, cá nhân có liên quan đến hoạt động tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh.

Điều 2. Giải thích thuật ngữ và từ viết tắt

Trong Quy chế này, các từ ngữ sau đây được hiểu như sau:

- UBCKNN:** Ủy ban Chứng khoán Nhà nước.
- Sở GDCK Việt Nam:** Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam.
- Sở GDCK Hà Nội:** Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội.
- Thành viên** là thành viên của Sở GDCK Việt Nam, bao gồm thành viên giao dịch và thành viên giao dịch đặc biệt trên thị trường chứng khoán phái sinh.
- Thành viên tạo lập thị trường** là thành viên giao dịch, thành viên giao dịch đặc biệt đồng thời là thành viên bù trừ đã đăng ký hoạt động tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh và được Sở GDCK Việt Nam chấp thuận tư cách thành viên tạo lập thị trường để thực hiện các giao dịch mua, bán nhằm tạo thanh khoản

cho một hoặc một số mã chứng khoán phái sinh trên cơ sở hợp đồng tạo lập thị trường ký với Sở GDCK Hà Nội.

6. *Sản phẩm chứng khoán phái sinh* bao gồm các loại Hợp đồng tương lai chỉ số, các loại Hợp đồng tương lai Trái phiếu Chính phủ và các loại chứng khoán phái sinh khác (nếu có) theo quy định pháp luật.

7. *Mã chứng khoán phái sinh* là mã giao dịch của chứng khoán phái sinh được niêm yết tại Sở GDCK Hà Nội.

8. *Hệ thống giao dịch* là hệ thống công nghệ thông tin dùng cho hoạt động giao dịch chứng khoán phái sinh tại Sở GDCK Hà Nội.

9. *Phương tiện công bố thông tin* là hệ thống của Sở GDCK được sử dụng để công bố thông tin và tiếp nhận báo cáo của thành viên.

10. *Chênh lệch giá* là chênh lệch giữa giá chào bán thấp nhất và giá chào mua cao nhất.

11. *Tỷ lệ chênh lệch giá* là tỷ lệ phần trăm chênh lệch giá giữa giá chào bán thấp nhất và giá chào mua cao nhất so với giá chào mua cao nhất. Công thức tính cụ thể như sau:

$$\text{Tỷ lệ chênh lệch giá} = \frac{\text{Giá chào bán thấp nhất} - \text{Giá chào mua cao nhất}}{\text{Giá chào mua cao nhất}} \times 100\%$$

12. *Lệnh tạo lập thị trường* là lệnh chào giá vào hệ thống giao dịch để thực hiện nghĩa vụ báo giá tạo lập thị trường. Chỉ các thành viên tạo lập thị trường mới được phép nhập lệnh tạo lập thị trường vào hệ thống giao dịch.

Lệnh tạo lập thị trường có ký hiệu nhận lệnh riêng để phân biệt với lệnh khác của chính thành viên tạo lập thị trường và phân biệt với lệnh tạo lập thị trường của thành viên tạo lập thị trường khác.

13. *Hợp đồng tạo lập thị trường* là hợp đồng ký kết giữa Sở GDCK Hà Nội với các tổ chức đăng ký tạo lập thị trường cho mục đích tạo thanh khoản cho một hoặc một số mã chứng khoán phái sinh nhất định.

14. *Hồ sơ cá nhân* bao gồm bản thông tin cá nhân theo mẫu quy định tại Phụ lục số 02/TLTT ban hành kèm theo Quy chế này.

Chương II

ĐĂNG KÝ THÀNH VIÊN TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG

Điều 3. Hồ sơ đăng ký thành viên tạo lập thị trường

1. Tài liệu quy định tại điểm a, b khoản 3 Điều 24 Nghị định số 158/2020/NĐ-CP ngày 31/12/2020 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh (Nghị định số 158/2020/NĐ-CP).

2. Bản thuyết minh về hạ tầng công nghệ thông tin, quy trình nghiệp vụ bao gồm các tài liệu sau:

a) Thuyết minh cơ sở vật chất, hệ thống công nghệ thông tin phục vụ hoạt động tạo lập thị trường theo mẫu quy định tại Phụ lục số 01/TLTT ban hành kèm theo Quy chế này;

b) Quy trình giao dịch tạo lập thị trường; quy trình quản lý rủi ro hoạt động tạo lập thị trường; quy trình kiểm soát nội bộ hoạt động tạo lập thị trường.

Điều 4. Trình tự, thủ tục đăng ký thành viên tạo lập thị trường

1. Khi xét thấy cần thiết áp dụng cơ chế tạo lập thị trường đối với một sản phẩm chứng khoán phái sinh hoặc mã chứng khoán phái sinh, Sở GDCK Hà Nội công bố thông tin về việc tìm kiếm thành viên tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Hà Nội. Thông tin công bố bao gồm các nội dung sau:

a) Sản phẩm chứng khoán phái sinh hoặc mã chứng khoán phái sinh cần tạo lập thị trường;

b) Thời điểm áp dụng cơ chế tạo lập thị trường;

c) Yêu cầu về nghĩa vụ báo giá (điều kiện phát sinh nghĩa vụ báo giá, thời gian báo giá, tần suất báo giá, tỷ lệ chênh lệch giá, khối lượng giao dịch tối thiểu...).

2. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày công bố, Sở GDCK Hà Nội báo cáo Sở GDCK Việt Nam về việc tìm kiếm thành viên tạo lập thị trường.

3. Trên cơ sở thông tin công bố của Sở GDCK Hà Nội tại khoản 1 Điều này, tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường nộp hồ sơ theo quy định tại Điều 3 Quy chế này cho Sở GDCK Việt Nam, đồng thời nộp hồ sơ theo quy định tại khoản 2 Điều 3 Quy chế này cho Sở GDCK Hà Nội.

4. Trong thời hạn 02 ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ đăng ký thành viên tạo lập thị trường, Sở GDCK Việt Nam thông báo trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam về việc tiếp nhận hồ sơ của tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường.

5. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ theo quy định tại khoản 2 Điều 3 Quy chế này, Sở GDCK Hà Nội có ý kiến bằng văn bản về hồ sơ gửi Sở GDCK Việt Nam.

6. Trong thời hạn 07 ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ đăng ký, trường hợp hồ sơ không đầy đủ, hợp lệ, Sở GDCK Việt Nam có văn bản yêu cầu tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường sửa đổi, bổ sung hồ sơ.

7. Trong thời hạn 60 ngày kể từ ngày Sở GDCK Việt Nam có văn bản yêu cầu sửa đổi, bổ sung hồ sơ, tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường phải hoàn thiện hồ sơ theo yêu cầu. Quá thời hạn trên, nếu tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường không hoàn thiện hồ sơ, Sở GDCK Việt Nam dừng việc xem

xét hồ sơ đăng ký và gửi công văn thông báo tới tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường nêu rõ lý do. Tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường phải làm lại hồ sơ đăng ký thành viên tạo lập thị trường mới nếu tiếp tục thực hiện đăng ký tạo lập thị trường.

8. Trong thời gian xét duyệt hồ sơ đăng ký thành viên tạo lập thị trường, nếu có bất kỳ thay đổi nào so với hồ sơ đăng ký ban đầu, tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường có trách nhiệm bổ sung hồ sơ theo đúng quy định.

9. Trong thời hạn 07 ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ đầy đủ, hợp lệ, Sở GDCK Việt Nam có văn bản yêu cầu:

a) Tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường hoàn thiện cơ sở vật chất, cài đặt hệ thống, kết nối các phần mềm truyền nhận dữ liệu giao dịch và thử nghiệm chức năng tạo lập thị trường với Sở GDCK Hà Nội;

b) Sở GDCK Hà Nội hướng dẫn tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường cập nhật các thông số kỹ thuật, hệ thống vào hồ sơ đăng ký (nếu có) và hỗ trợ tổ chức đăng ký thành viên hoàn tất các thủ tục nêu trên.

10. Trong thời hạn 30 ngày kể từ ngày nhận được văn bản của Sở GDCK Việt Nam, tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường có trách nhiệm phối hợp với Sở GDCK Hà Nội hoàn thành các yêu cầu quy định tại khoản 9 Điều này và gửi bản cập nhật hồ sơ đăng ký theo hướng dẫn của Sở GDCK Hà Nội cho Sở GDCK Việt Nam (nếu có).

11. Trong thời hạn 07 ngày làm việc kể từ ngày nhận được báo cáo bằng văn bản của tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường về việc hoàn tất các yêu cầu quy định tại khoản 9 Điều này, Sở GDCK Hà Nội thông báo kế hoạch kiểm thử chức năng tạo lập thị trường với tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường, đồng thời báo cáo Sở GDCK Việt Nam.

12. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày kết thúc kiểm thử chức năng tạo lập thị trường, Sở GDCK Hà Nội báo cáo kết quả kiểm thử cho Sở GDCK Việt Nam. Trong trường hợp kết quả kiểm thử chức năng tạo lập thị trường không đạt yêu cầu thì ghi rõ lý do.

13. Trong thời hạn 05 ngày làm việc kể từ ngày nhận được báo cáo thử nghiệm chức năng tạo lập thị trường đạt yêu cầu của Sở GDCK Hà Nội, Sở GDCK Việt Nam ban hành thông báo chấp thuận nguyên tắc làm thành viên tạo lập thị trường và có văn bản yêu cầu tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường thực hiện:

a) Ký hợp đồng tạo lập thị trường với Sở GDCK Hà Nội và các hợp đồng cung cấp các dịch vụ khác (nếu có);

b) Thông báo tài khoản giao dịch thực hiện nghiệp vụ tạo lập thị trường với Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội;

c) Đăng ký ngày chính thức bắt đầu thực hiện hoạt động tạo lập thị trường với Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội.

14. Trong thời hạn 05 ngày làm việc kể từ ngày nhận được báo cáo kèm tài liệu chứng minh tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường hoàn tất các yêu cầu quy định tại khoản 13 Điều này, Sở GDCK Việt Nam ban hành quyết định chấp thuận tư cách thành viên tạo lập thị trường.

15. Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày ban hành quyết định, Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội thực hiện công bố thông tin về việc chấp thuận tư cách thành viên tạo lập thị trường, đồng thời thông báo mã chứng khoán phải sinh được tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội.

Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày nhận được quyết định, thành viên tạo lập thị trường thực hiện công bố thông tin trên trang thông tin điện tử của thành viên.

16. Sở GDCK Việt Nam có quyền từ chối chấp thuận tư cách thành viên tạo lập thị trường theo quy định tại khoản 8 Điều 24 Nghị định số 158/2020/NĐ-CP.

Chương III

QUYỀN VÀ NGHĨA VỤ CỦA THÀNH VIÊN TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG

Điều 5. Quyền của thành viên tạo lập thị trường

1. Thành viên tạo lập thị trường có quyền theo quy định tại điểm a khoản 3 Điều 25 Nghị định số 158/2020/NĐ-CP.

2. Được hưởng các quyền theo quy định tại hợp đồng tạo lập thị trường ký kết với Sở GDCK Hà Nội.

Điều 6. Nghĩa vụ của thành viên tạo lập thị trường

1. Thành viên tạo lập thị trường có nghĩa vụ theo quy định tại điểm b khoản 3 Điều 25 Nghị định số 158/2020/NĐ-CP.

2. Thực hiện nghĩa vụ báo giá tạo lập thị trường theo quy định tại Điều 7 Quy chế này.

3. Thực hiện nghĩa vụ theo quy định tại hợp đồng tạo lập thị trường ký kết với Sở GDCK Hà Nội.

Điều 7. Nghĩa vụ báo giá tạo lập thị trường

1. Hoạt động báo giá tạo lập thị trường phải tuân thủ nguyên tắc sau:

a) Thành viên tạo lập thị trường phải trung thực và thiện chí khi thực hiện chức năng tạo lập thị trường vì mục tiêu bảo đảm thị trường hoạt động hiệu quả, ổn định;

b) Thành viên tạo lập thị trường chỉ được đặt lệnh tạo lập thị trường cho các giao dịch tạo lập thị trường và chỉ được đặt lệnh giới hạn cho các giao dịch tạo lập thị trường;

c) Thành viên tạo lập thị trường chỉ được thực hiện báo giá tạo lập thị trường trong phiên khớp lệnh liên tục.

d) Thành viên tạo lập thị trường được đồng thời thực hiện giao dịch tạo lập thị trường và tự doanh. Thành viên tạo lập thị trường có trách nhiệm đảm bảo lệnh tạo lập thị trường không được khớp với lệnh tự doanh của chính mình.

2. Khi thực hiện báo giá tạo lập thị trường, thành viên tạo lập thị trường phải đảm bảo tuân thủ quy định về thời gian giao dịch, khối lượng giao dịch tối thiểu, tần suất, tỷ lệ chênh lệch giá và các nghĩa vụ báo giá khác (nếu có) theo quy định tại hợp đồng tạo lập thị trường và quy định pháp luật.

Điều 8. Miễn trừ nghĩa vụ tạo lập thị trường

Thành viên tạo lập thị trường được miễn trừ nghĩa vụ báo giá tạo lập thị trường trong các trường hợp sau:

1. Các trường hợp theo quy định tại khoản 3 Điều 17 Nghị định số 158/2020/NĐ-CP đối với thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh.

2. Trong ngày đáo hạn đối với chứng khoán phái sinh.

3. Các trường hợp khác theo quy định tại hợp đồng tạo lập thị trường ký kết giữa Sở GDCK Hà Nội và thành viên tạo lập thị trường (nếu có).

Điều 9. Đánh giá hoạt động tạo lập thị trường

1. Việc đánh giá hoạt động tạo lập thị trường do Sở GDCK Hà Nội thực hiện. Sở GDCK Hà Nội chỉ thực hiện đánh giá đối với các thành viên tạo lập thị trường đang hoạt động.

2. Sở GDCK Hà Nội thực hiện đánh giá hoạt động của thành viên tạo lập thị trường định kỳ hàng tháng trên mỗi mã chứng khoán phái sinh mà thành viên đăng ký tạo lập thị trường. Thành viên tạo lập thị trường được đánh giá là hoàn thành nghĩa vụ tạo lập thị trường trong tháng khi hoàn thành các nghĩa vụ tạo lập thị trường theo quy định tại hợp đồng tạo lập thị trường, quy định khác của Sở GDCK Hà Nội (nếu có) và quy định pháp luật.

3. Thành viên tạo lập thị trường được Sở GDCK Hà Nội đánh giá hoàn thành nghĩa vụ tạo lập thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều này được hưởng ưu đãi giá dịch vụ giao dịch do Sở GDCK Hà Nội quy định, phù hợp với mức giảm giá dịch vụ giao dịch theo quy định pháp luật.

4. Trong quá trình thực hiện đánh giá, Sở GDCK Hà Nội có quyền yêu cầu các thành viên tạo lập thị trường cung cấp các tài liệu cần thiết phục vụ việc đánh giá. Các thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh có trách nhiệm cung cấp đầy đủ, chính xác và đúng thời hạn các tài liệu theo yêu cầu của Sở GDCK Hà Nội.

5. Sở GDCK Hà Nội có trách nhiệm báo cáo Sở GDCK Việt Nam kết quả đánh giá hoạt động tạo lập thị trường của thành viên tạo lập thị trường trong thời hạn 10 ngày làm việc kể từ ngày kết thúc tháng.

Chương IV

XỬ LÝ VI PHẠM, ĐÌNH CHỈ, HỦY BỎ TƯ CÁCH THÀNH VIÊN TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG

Điều 10. Các hình thức xử lý vi phạm

Thành viên tạo lập thị trường vi phạm các quy định của Quy chế này, Sở GDCK Việt Nam sẽ áp dụng một hoặc một số hình thức xử lý vi phạm sau:

1. Đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường.
2. Hủy bỏ bắt buộc tư cách thành viên tạo lập thị trường.

Điều 11. Nguyên tắc, thời hạn xử lý vi phạm

1. Việc xử lý vi phạm chỉ thực hiện đối với các vi phạm quy định tại Quy chế này.

2. Thời hạn xử lý vi phạm được quy định như sau:

a) Đối với vi phạm đã kết thúc, thời hạn xử lý vi phạm là 01 năm kể từ ngày chấm dứt hành vi vi phạm;

b) Đối với vi phạm đang được thực hiện, thời hạn xử lý vi phạm là 01 năm kể từ ngày phát hiện hành vi vi phạm.

Điều 12. Trình tự, thủ tục xử lý vi phạm

Trình tự, thủ tục xử lý vi phạm như sau:

1. Khi phát hiện vi phạm, Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội yêu cầu thành viên tạo lập thị trường giải trình (nếu cần), thu thập bằng chứng. Trường hợp Sở GDCK Hà Nội là đơn vị phát hiện vi phạm, trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ khi phát hiện vi phạm, Sở GDCK Hà Nội báo cáo Sở GDCK Việt Nam để xử lý vi phạm theo quy định.

2. Sở GDCK Việt Nam yêu cầu thành viên tạo lập thị trường giải trình về lỗi vi phạm trước khi quyết định hình thức xử lý vi phạm (nếu cần).

3. Căn cứ tính chất, mức độ vi phạm, Sở GDCK Việt Nam quyết định hình thức xử lý vi phạm phù hợp và thực hiện công bố thông tin theo quy định.

4. Trong thời hạn 15 ngày kể từ ngày văn bản xử lý vi phạm có hiệu lực, thành viên tạo lập thị trường có quyền yêu cầu Sở GDCK Việt Nam xem xét lại văn bản xử lý vi phạm. Thành viên tạo lập thị trường có nghĩa vụ thực hiện theo văn bản xử lý vi phạm có hiệu lực của Sở GDCK Việt Nam cho đến khi có quyết định khác. Trường hợp giữ nguyên quyết định xử lý vi phạm, Sở GDCK Việt Nam có văn bản trả lời và nêu rõ lý do.

Điều 13. Thẩm quyền xử lý vi phạm

1. Tổng Giám đốc Sở GDCK Việt Nam quyết định hình thức xử lý vi phạm đối với thành viên tạo lập thị trường.

2. Sở GDCK Hà Nội theo thẩm quyền chịu trách nhiệm giám sát thành viên tạo lập thị trường tuân thủ nghĩa vụ tạo lập thị trường theo quy định pháp luật,

quy chế này, hợp đồng tạo lập thị trường ký với Sở GDCK Hà Nội và các quy chế, quy định, quy trình khác có liên quan. Sở GDCK Hà Nội phải báo cáo và đề xuất Sở GDCK Việt Nam xử lý vi phạm theo thẩm quyền.

Điều 14. Đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường

1. Sở GDCK Việt Nam đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường của thành viên tạo lập thị trường theo quy định tại khoản 1 Điều 23 Thông tư số 58/2021/TT-BTC ngày 12/7/2021 của Bộ trưởng Bộ Tài chính hướng dẫn một số điều của Nghị định số 158/2020/NĐ-CP ngày 31/12/2020 của Chính phủ về chứng khoán phái sinh và thị trường chứng khoán phái sinh (Thông tư số 58/2021/TT-BTC).

2. Thời gian đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường không quá 90 ngày. Trường hợp thành viên tạo lập thị trường không khắc phục được nguyên nhân bị đình chỉ, Sở GDCK Việt Nam sẽ hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường.

3. Thời gian và phạm vi đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường được quy định cụ thể trong quyết định đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường của Sở GDCK Việt Nam. Ngày đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường do Sở GDCK Việt Nam quyết định.

4. Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày ban hành quyết định, Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội thực hiện công bố thông tin về việc đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường của thành viên tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội.

Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày nhận được quyết định, thành viên tạo lập thị trường thực hiện công bố thông tin trên trang thông tin điện tử của thành viên.

5. Thành viên tạo lập thị trường phải báo cáo Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội sau khi khắc phục được nguyên nhân bị đình chỉ hoạt động tạo lập thị trường. Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ khi nhận được báo cáo khắc phục kèm tài liệu chứng minh của thành viên tạo lập thị trường và ý kiến của Sở GDCK Hà Nội về việc khắc phục của thành viên tạo lập thị trường, Sở GDCK Việt Nam có văn bản thông báo cho thành viên tạo lập thị trường việc tiếp tục đình chỉ hoặc khôi phục hoạt động tạo lập thị trường cho thành viên tạo lập thị trường; đồng thời công bố thông tin trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam.

Điều 15. Hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường

1. Thành viên tạo lập thị trường được tự nguyện hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường theo quy định tại điểm a khoản 1 Điều 24 Thông tư số 58/2021/TT-BTC. Trong trường hợp này, thành viên tạo lập thị trường phải nộp hồ sơ tự nguyện hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường cho Sở GDCK Việt Nam tối thiểu 30 ngày trước ngày đề xuất xin hủy bỏ. Hồ sơ tự nguyện hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường bao gồm:

a) Giấy đề nghị hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường theo mẫu quy định tại Phụ lục số 03/TLTT ban hành kèm theo Quy chế này;

b) Biên bản thanh lý hợp đồng tạo lập thị trường với Sở GDCK Hà Nội.

2. Thành viên tạo lập thị trường bị Sở GDCK Việt Nam hủy bỏ bắt buộc tư cách thành viên tạo lập thị trường theo quy định tại khoản 2 Điều 24 Thông tư số 58/2021/TT-BTC.

3. Trình tự, thủ tục hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường

a) Đối với trường hợp quy định tại khoản 1 Điều này, trình tự hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường như sau:

- Trong thời hạn 02 ngày làm việc kể từ ngày nhận được hồ sơ hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường của thành viên đầy đủ, hợp lệ, Sở GDCK Việt Nam công bố thông tin trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam về việc ngừng hoạt động tạo lập thị trường để tự nguyện hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường và thông báo cho thành viên tạo lập thị trường, Sở GDCK Hà Nội về ngày dự kiến ngừng hoạt động tạo lập thị trường;

- Sở GDCK Hà Nội xác nhận ngày ngừng hoạt động tạo lập thị trường và báo cáo Sở GDCK Việt Nam;

- Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày nhận được báo cáo của Sở GDCK Hà Nội, Sở GDCK Việt Nam ban hành quyết định hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường;

- Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày ban hành quyết định, Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội thực hiện công bố thông tin về việc hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội.

b) Đối với các trường hợp quy định tại khoản 2 Điều này, trình tự hủy bỏ bắt buộc tư cách thành viên tạo lập thị trường như sau:

- Sau khi xảy ra các vi phạm dẫn tới hủy bỏ bắt buộc tư cách thành viên tạo lập thị trường, Sở GDCK Việt Nam thực hiện công bố thông tin về việc ngừng hoạt động tạo lập thị trường của thành viên tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam và thông báo cho thành viên tạo lập thị trường, Sở GDCK Hà Nội về ngày dự kiến ngừng hoạt động tạo lập thị trường;

- Sở GDCK Hà Nội xác nhận ngày ngừng hoạt động tạo lập thị trường và báo cáo Sở GDCK Việt Nam sau khi hoàn thành thanh lý hợp đồng tạo lập thị trường với thành viên tạo lập thị trường;

- Trong thời hạn 03 ngày làm việc kể từ ngày nhận được báo cáo của Sở GDCK Hà Nội, Sở GDCK Việt Nam ban hành quyết định hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường;

- Trong thời hạn 24 giờ kể từ ngày ban hành quyết định, Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội thực hiện công bố thông tin về việc hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường trên phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội.

4. Thành viên tạo lập thị trường phải thực hiện công bố thông tin về việc hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường tại khoản 3 Điều này trong thời hạn 24

giờ kể từ khi nhận được quyết định của Sở GDCK Việt Nam.

5. Trong thời hạn 30 ngày kể từ ngày hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường, thành viên tạo lập thị trường có trách nhiệm thực hiện các giao dịch đóng các vị thế mở của hoạt động tạo lập thị trường hoặc chuyển các vị thế mở sang tài khoản tự doanh.

Chương V

CHẾ ĐỘ BÁO CÁO

Điều 16. Chế độ báo cáo

Thành viên tạo lập thị trường phải gửi cho Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội các báo cáo sau:

1. Trong thời hạn 05 ngày làm việc kể từ ngày kết thúc tháng, báo cáo tháng về tình hình thực hiện nghĩa vụ tạo lập thị trường theo mẫu quy định tại Phụ lục số 04/TLTT ban hành kèm theo Quy chế này. Thời gian chốt số liệu báo cáo tháng tính từ ngày 01 đến ngày cuối cùng của tháng thuộc kỳ báo cáo.

2. Trường hợp cần thiết, Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội có quyền yêu cầu thành viên tạo lập thị trường báo cáo bằng văn bản, trong đó nêu rõ nội dung và thời hạn báo cáo.

Điều 17. Hình thức báo cáo

1. Thành viên tạo lập thị trường gửi Sở GDCK Việt Nam, Sở GDCK Hà Nội báo cáo dưới hình thức dữ liệu điện tử thông qua phương tiện công bố thông tin của Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội.

2. Trường hợp không thể gửi báo cáo qua phương tiện công bố thông tin vì lý do bất khả kháng (hệ thống mạng, máy chủ gặp sự cố, không thể sử dụng chứng thư số...), thành viên gửi báo cáo dưới hình thức văn bản giấy tới Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội; đồng thời, gửi bản dữ liệu điện tử qua e-mail đúng thời hạn quy định tại Quy chế này. Thành viên thông báo ngay cho Sở GDCK Việt Nam biết lý do không thể thực hiện gửi báo cáo qua phương tiện công bố thông tin để Sở GDCK Việt Nam hướng dẫn, khắc phục.

Chương VI

TRÁCH NHIỆM QUẢN LÝ, GIÁM SÁT VÀ TỔ CHỨC THỰC HIỆN

Điều 18. Trách nhiệm của Sở GDCK Việt Nam và Sở GDCK Hà Nội

1. Sở GDCK Việt Nam:

a) Chấp thuận, đình chỉ hoạt động, hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường;

- b) Giám sát thành viên tạo lập thị trường trong việc duy trì điều kiện đăng ký thành viên và thực hiện nghĩa vụ báo cáo;
- c) Xử lý vi phạm theo thẩm quyền đối với thành viên tạo lập thị trường;
- d) Giám sát các hoạt động khác của thành viên tạo lập thị trường theo quy định pháp luật.

2. Sở GDCK Hà Nội:

- a) Phối hợp với tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường đã được chấp thuận nguyên tắc làm tạo lập thị trường xây dựng hợp đồng tạo lập thị trường. Hợp đồng tạo lập thị trường phải bao gồm các nội dung về: Thời gian giao dịch, khối lượng giao dịch tối thiểu, tần suất, tỷ lệ chênh lệch giá...;
- b) Hướng dẫn tổ chức đăng ký thành viên tạo lập thị trường, thành viên tạo lập thị trường triển khai chức năng tạo lập thị trường với Sở GDCK Hà Nội;
- c) Thông báo danh sách các mã chứng khoán phái sinh cần tạo lập và dừng tạo lập thị trường; ký bổ sung mã chứng khoán phái sinh mới để tạo lập thị trường với thành viên tạo lập thị trường;
- d) Thực hiện ký kết hoặc chấm dứt hợp đồng tạo lập thị trường với các thành viên tạo lập thị trường; thực hiện sửa đổi, bổ sung hợp đồng tạo lập thị trường khi cần thiết. Sở GDCK Hà Nội báo cáo Sở GDCK Việt Nam trong thời hạn 05 ngày làm việc sau khi hợp đồng được ký kết, sửa đổi, bổ sung hoặc chấm dứt kèm theo bản sao các hợp đồng này;
- đ) Giám sát thành viên tạo lập thị trường thực hiện nghĩa vụ báo giá tạo lập thị trường và định kỳ thực hiện đánh giá hoạt động tạo lập thị trường;
- e) Quy định mức giảm giá dịch vụ giao dịch cho thành viên tạo lập thị trường và xác định giá dịch vụ giao dịch hàng tháng cho thành viên tạo lập thị trường;
- g) Phối hợp với Sở GDCK Việt Nam trong việc đăng ký, xử lý vi phạm thành viên tạo lập thị trường, đình chỉ, hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường;
- h) Chia sẻ thông tin và thực hiện các công tác giám sát, các hoạt động khác của thành viên tạo lập thị trường khi cần thiết.

Điều 19. Tổ chức thực hiện

- 1. Trường hợp các văn bản quy phạm pháp luật được dẫn chiếu để áp dụng tại Quy chế này được sửa đổi, bổ sung, thay thế thì thực hiện theo quy định tại văn bản sửa đổi, bổ sung, thay thế.
- 2. Sở GDCK Hà Nội có trách nhiệm thực hiện các quy định tại Quy chế này, giám sát việc tuân thủ nghĩa vụ của thành viên tạo lập thị trường theo quy định tại Quy chế này và quy định của pháp luật chứng khoán về chứng khoán và thị trường chứng khoán.

3. Việc sửa đổi, bổ sung Quy chế này do Tổng Giám đốc Sở GDCK Việt Nam quyết định sau khi được UBCKNN chấp thuận và Hội đồng Thành viên Sở GDCK Việt Nam thông qua. *h*



[Signature]
Phạm Văn Hoàng

Phụ lục 01/TLTT: Thuyết minh cơ sở vật chất, hệ thống CNTT phục vụ hoạt động tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh
(Kèm theo Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh ban hành theo Quyết định số/QĐ-SGDVN ngàytháng..... năm 2024 của Tổng Giám đốc Sở GDCK Việt Nam)

TÊN THÀNH VIÊN

Số: .../ ...

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

..., ngày ... tháng ... năm ...

**THUYẾT MINH CƠ SỞ VẬT CHẤT,
HỆ THỐNG CÔNG NGHỆ THÔNG TIN
PHỤC VỤ HOẠT ĐỘNG TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG**

I. Thông tin chung

1. Tên tổ chức đăng ký

- Địa chỉ trụ sở chính:

- Điện thoại:

Fax:

- Website:

Email (nếu có):

2. Danh sách nhân viên công nghệ thông tin và nhân viên nghiệp vụ tạo lập thị trường (kèm hồ sơ cá nhân)

STT	Họ tên	Giới tính	Ngày sinh	Số định danh cá nhân/hộ chiếu	Chức vụ	Điện thoại	Email

II. Hình thức và địa điểm kết nối giao dịch

1. Hình thức kết nối giao dịch.

2. Địa điểm kết nối giao dịch.

III. Cơ sở vật chất phục vụ hoạt động tạo lập thị trường

1. Quản lý việc ra vào bằng thẻ từ hoặc các thiết bị tương đương hoặc có khóa được quản lý bởi nhân viên công nghệ thông tin.

2. Hệ thống camera giám sát.

3. Hệ thống điện dự phòng.

4. Hệ thống phòng cháy, chữa cháy.

IV. Hệ thống công nghệ thông tin phục vụ giao dịch tạo lập thị trường

1. Hệ thống mạng: đường truyền chính, đường truyền dự phòng, sơ đồ hệ thống mạng, thuyết minh kỹ thuật.
2. Hệ thống phần mềm giao dịch trực tuyến: Bao gồm số lượng máy, cấu hình máy (chính + dự phòng), Hồ sơ kỹ thuật mô tả hệ thống phần mềm giao dịch trực tuyến phục vụ cho giao dịch tạo lập thị trường .
3. Hệ thống an ninh bảo mật: Bao gồm các chính sách an ninh bảo mật thiết lập cho hệ thống, thiết bị an ninh bảo mật, các luật về an ninh bảo mật được thiết lập trên các thiết bị an ninh bảo mật.
4. Các nội dung khác: Bao gồm danh mục trang thiết bị công nghệ thông tin phục vụ hoạt động giao dịch tạo lập thị trường.

....., ngày ... tháng ... năm ...
Người đại diện theo pháp luật
(Chức danh)
(Ký, ghi rõ họ tên, đóng dấu)

Phụ lục 02/TLTT: Mẫu bản thông tin cá nhân
(Kèm theo Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phải sinh ban hành theo Quyết định số
...../QĐ-SGDVN ngàytháng..... năm 2024 của Tổng Giám đốc Sở GD&ĐT Việt Nam)

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

BẢN THÔNG TIN CÁ NHÂN
(Áp dụng nhân viên công nghệ thông tin)

Ảnh 4x6
(dán ảnh và
đóng dấu
giáp lai)

1. Họ và tên: Nam/nữ
2. Ngày, tháng, năm sinh:
3. Nơi sinh:
4. Quốc tịch: (Các quốc tịch hiện có)
5. Số định danh cá nhân/ hộ chiếu:..... ngày cấp.....nơi cấp..... có giá trị đến ngày..... (đối với hộ chiếu hoặc số giấy tờ chứng thực cá nhân khác)
6. Hộ khẩu thường trú:
7. Địa chỉ liên lạc (thường xuyên):
8. Email: Điện thoại:
9. Trình độ chuyên môn:
10. Nghề nghiệp:
11. Quá trình đào tạo chuyên môn:

Thời gian	Nơi đào tạo	Chuyên ngành đào tạo	Bằng cấp

12. Quá trình làm việc:

Thời gian	Nơi làm việc	Vị trí công việc

13. Kê khai người có liên quan (kê khai toàn bộ người có liên quan theo quy định tại Luật Chứng khoán)

Họ và tên/Tên tổ chức có liên quan	Mối quan hệ với người khai	Số GCNĐKKD/định danh cá nhân/ hộ chiếu	Nơi làm việc/học tập/ khác	Vị trí công việc

Tôi cam kết và chịu trách nhiệm về tính chính xác, trung thực các nội dung nêu trên.

..., ngày... tháng... năm ...

Chúng thực chữ ký của người khai hoặc xác nhận của tổ chức đang làm việc hoặc xác nhận của Ủy ban nhân dân cấp có thẩm quyền về việc người khai đăng ký hộ khẩu thường trú tại địa bàn

Người khai

(Ký, ghi rõ họ tên)

**Phụ lục 03/TLTT: Mẫu Giấy đề nghị hủy bỏ tư cách
thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh**
(Kèm theo Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh ban hành theo Quyết định số
...../QĐ-SGDVN ngàytháng..... năm 2024 của Tổng Giám đốc Sở GDCK Việt Nam)

TÊN THÀNH VIÊN

Số: / ...

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

..., ngày ... tháng ... năm ...

**GIẤY ĐỀ NGHỊ HỦY BỎ TƯ CÁCH THÀNH VIÊN
TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH**

Kính gửi: Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam

Chúng tôi, công ty chứng khoán/ ngân hàng thương mại

.....

là Thành viên tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh của Sở GDCK Việt Nam
theo Quyết định số.....ngày.....

Nay, chúng tôi đề nghị được ngừng hoạt động giao dịch tạo lập thị trường kể từ
ngày .../.../.... để tiến hành thủ tục hủy bỏ tư cách thành viên tạo lập thị trường.

Lý do:

.....
.....

Chúng tôi cam kết thực hiện công bố thông tin về việc hủy bỏ tư cách thành
viên tạo lập thị trường theo quy định của Sở GDCK Việt Nam, đồng thời thực
hiện đầy đủ nghĩa vụ của thành viên tạo lập thị trường đối với Sở GDCK Việt
Nam và Sở GDCK Hà Nội cho các giao dịch diễn ra trước thời điểm hủy bỏ tư
cách thành viên tạo lập thị trường.

Chúng tôi xin cam đoan những lời khai trên đây là đúng sự thật. Nếu sai
chúng tôi xin hoàn toàn chịu trách nhiệm.

Đề nghị Sở GDCK Việt Nam xem xét, chấp thuận cho chúng tôi hủy bỏ tư
cách thành viên tạo lập thị trường.

....., ngày ... tháng ... năm ...

Người đại diện theo pháp luật

(Chức danh)

(Ký, ghi rõ họ tên, đóng dấu)

**Phụ lục 04/TLTT: Mẫu báo cáo nghĩa vụ tạo lập thị trường
chứng khoán phái sinh hàng tháng**
(Kèm theo Quy chế tạo lập thị trường chứng khoán phái sinh ban hành theo Quyết định số
...../QĐ-SGDVN ngàytháng..... năm 2024 của Tổng Giám đốc Sở GDCK Việt Nam)

TÊN THÀNH VIÊN

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

Số: / ...

..., ngày ... tháng ... năm ...

**BÁO CÁO NGHĨA VỤ TẠO LẬP THỊ TRƯỜNG
CHỨNG KHOÁN PHÁI SINH**
Tháng .../...

Kính gửi: - Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;
- Sở Giao dịch Chứng khoán Hà Nội.

I. Tổng hợp

STT	Mã hợp đồng	Bảo giá trong kỳ						Khớp lệnh trong kỳ					
		Mua			Bán			Mua			Bán		
		SL lệnh	KL	GT	SL lệnh	KL	GT	SL lệnh	KL	GT	SL lệnh	KL	GT

II. Chi tiết

1. Các lệnh vi phạm nghĩa vụ báo giá

Ngày thực hiện	Mã hợp đồng	Loại giao dịch (Mua/bán)	Thời gian báo giá	Bảo giá		Khớp lệnh		Nội dung vi phạm
				KL	Giá	KL	Giá	

2. Các vi phạm nghĩa vụ báo giá khác

Mã hợp đồng	Thời gian	Nội dung vi phạm
		<i>Ví dụ: vi phạm tần suất đặt lệnh/không đặt lệnh khi phát sinh điều kiện....</i>

TỔNG GIÁM ĐỐC
(Ký, đóng dấu, ghi rõ họ tên)