



**TÀI LIỆU HƯỚNG DẪN NHÀ ĐẦU TƯ THAM GIA GIAO DỊCH CÔNG CỤ NỢ TẠI SGDCKHN
(HNX)**

NỘI DUNG

- 1. KIẾN THỨC CHUNG VỀ TRÁI PHIẾU**
- 2. CÁC HÌNH THỨC GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU**
- 3. QUY TRÌNH GIAO DỊCH TPCP**
- 4. QUẢN LÝ TÀI KHOẢN KHÔNG LƯU KÝ TẠI HDBS**
- 5. GIAO DỊCH QUA CỒNG KẾT NỐI ĐIỆN TỬ**

I. KIẾN THỨC CHUNG VỀ TRÁI PHIẾU

1. Kiến thức cơ bản về Trái phiếu

	TPCP	TPCPBL	TPCQDP
Khái niệm	Là loại trái phiếu do Bộ Tài chính phát hành nhằm huy động vốn cho ngân sách nhà nước hoặc huy động vốn cho chương trình, dự án đầu tư cụ thể thuộc phạm vi đầu tư của nhà nước	Là loại trái phiếu do doanh nghiệp, tổ chức tài chính, tín dụng, ngân hàng chính sách của nhà nước phát hành và được Chính phủ bảo lãnh thanh toán	Là loại trái phiếu do Ủy ban nhân dân tỉnh, thành phố trực thuộc Trung ương phát hành nhằm huy động vốn cho công trình, dự án đầu tư của địa phương
Phân loại	- Trái phiếu kho bạc - Tín phiếu kho bạc - Công trái xây dựng Tổ quốc		
Kỳ hạn	- Trái phiếu kho bạc & Công trái xây dựng Tổ quốc : 1 năm trở lên - Tín phiếu kho bạc: 13 tuần, 26 tuần và 52 tuần	Kỳ hạn 1 năm trở lên	
Mệnh giá	100.000 đồng và bội số của 100.000 đồng		
Hình thức trái phiếu	–Chứng chỉ, bút toán ghi sổ hoặc dữ liệu điện tử. Hiện tại trái phiếu phát hành chủ yếu theo hình thức ghi sổ –Chủ thể phát hành quyết định cụ thể về hình thức trái phiếu đối với mỗi đợt phát hành		
Lãi suất	-Lãi suất cố định hoặc lãi suất thả nổi do chủ thể phát hành trong khung lãi suất do Bộ Tài chính quy định		
Phương thức phát hành	- Đấu thầu phát hành trái phiếu - Bảo lãnh phát hành trái phiếu - Đại lý phát hành trái phiếu - Bán lẻ trái phiếu	- Đấu thầu phát hành trái phiếu - Đại lý phát hành trái phiếu	- Đấu thầu phát hành trái phiếu - Bảo lãnh phát hành trái phiếu - Đại lý phát hành trái phiếu

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

2. Xác định giá Trái phiếu

2.1 Xác định giá thực hiện

2.1.1 Xác định giá thực hiện trong giao dịch mua bán thông thường, giao dịch vay trái phiếu và giao dịch bán kết hợp mua lại

a, Đối với trái phiếu thanh toán lãi định kỳ

$$GM = GG$$

Trong đó:

- GM: Giá thực hiện (làm tròn đến 01 đồng)
- GG: Giá gộp lãi
- Đối với TPCP có kỳ hạn còn lại từ 01 năm trở lên, áp dụng quy tắc tính toán ngày thực tế/ngày thực tế
- Đối với TPCP có kỳ hạn còn lại dưới 01 năm, áp dụng quy tắc tính toán ngày thực tế/365.

b) Đối với trái phiếu không thanh toán lãi định kỳ và tín phiếu

$$GM = G$$

Trong đó:

- G: Giá yết
- Đối với trái phiếu không thanh toán lãi định kỳ có kỳ hạn còn lại trên 01 năm, cách xác định ngày trong tính toán áp dụng quy tắc ngày thực tế/ngày thực tế.
- Đối với trái phiếu không thanh toán lãi định kỳ có kỳ hạn còn lại dưới 01 năm và tín phiếu, cách xác định ngày trong tính toán áp dụng quy tắc ngày thực tế/365.

2.1.2 Xác định giá thực hiện trong giao dịch mua bán lại

a) Đối với trái phiếu thanh toán lãi định kỳ

$$GM = GG (1 - H)$$

Trong đó:

- GM: Giá thực hiện (làm tròn đến 01 đồng)
- H: Tỷ lệ phòng vệ rủi ro được quy đổi sang số thập phân

b) Đối với trái phiếu không thanh toán lãi định kỳ và tín phiếu

$$GM = G (1 - H)$$

Trong đó:

- G: Giá yết
- H: Tỷ lệ phòng vệ rủi ro được quy đổi sang số thập phân

2.2 Xác định giá gộp lãi

2.2.1 Đối với trái phiếu có phương thức thanh toán lãi vào cuối kỳ

a) Xác định giá gộp lãi trong ngày giao dịch hưởng quyền

$$GG = G + Cc$$

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

Trong đó:

- GG: Giá gộp lãi.
- G: Giá yết.
- Cc: Lãi coupon tích gộp trong ngày giao dịch hưởng quyền.

b) Xác định giá gộp lãi trong ngày giao dịch không hưởng quyền

$$GG = G - Cx$$

Trong đó:

- Cx: Lãi coupon tích gộp trong ngày giao dịch không hưởng quyền

c) Xác định giá gộp lãi trong trường hợp ngày thanh toán trùng với ngày trả lãi danh nghĩa

$$GG = G$$

2.2.2 Đối với trái phiếu có phương thức thanh toán lãi vào đầu kỳ**a) Xác định giá gộp lãi trong ngày giao dịch hưởng quyền**

- Giá gộp lãi trong ngày giao dịch hưởng quyền được xác định theo công thức:

$$GG = G - Cx$$

Trong đó:

- GG: Giá gộp lãi.
- G: Giá yết.
- Cx: Lãi coupon tích gộp trong ngày giao dịch không hưởng quyền.

a) Xác định giá gộp lãi trong ngày giao dịch hưởng quyền

- Đối với trái phiếu có lãi suất danh nghĩa cố định, thanh toán lãi định kỳ và có kỳ trả lãi đầu tiên dài hơn so với các kỳ trả lãi tiếp theo, và ngày thanh toán của giao dịch diễn ra trước hoặc trùng với ngày trả lãi danh nghĩa thông thường theo giả định của kỳ trả lãi đầu tiên, giá gộp lãi được xác định theo công thức sau:

$$GG = G - MG \times Rc \times (D'n/E1 + 1)$$

Trong đó:

- MG: Mệnh giá trái phiếu.
- $Rc = Lc/k$ trong đó Lc: Lãi suất danh nghĩa trái phiếu (%/năm); k: Số lần thanh toán lãi trong năm.
- D'n: Số ngày từ ngày thanh toán của giao dịch đến ngày trả lãi danh nghĩa thông thường theo giả định tiếp theo gần nhất
- E1: Số ngày trong kỳ trả lãi trái phiếu thông thường theo giả định có ngày phát hành trái phiếu lần đầu diễn ra

b) Xác định giá gộp lãi trong ngày giao dịch không hưởng quyền

- Giá gộp lãi trong ngày giao dịch không hưởng quyền được xác định theo công thức sau:

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

$$GG = G - Cx - MG \times Rc$$

- Đối với trái phiếu có lãi suất danh nghĩa cố định, thanh toán lãi định kỳ và có kỳ trả lãi đầu tiên ngắn hơn so với các kỳ trả lãi tiếp theo, và ngày thanh toán của giao dịch diễn ra trong kỳ trả lãi đầu tiên, giá gộp lãi được xác định theo công thức sau:

$$GG = G - Cx - MG \times Rc \times D1/E2$$

Trong đó:

- D1: Số ngày từ ngày phát hành trái phiếu lần đầu đến ngày trả lãi danh nghĩa tiếp theo gần nhất
- E2: Số ngày trong kỳ trả lãi trái phiếu thông thường theo giả định có ngày thanh toán giao dịch diễn ra
- Đối với trái phiếu có lãi suất danh nghĩa cố định, thanh toán lãi định kỳ và có kỳ trả lãi đầu tiên dài hơn so với các kỳ trả lãi tiếp theo, và ngày thanh toán của giao dịch diễn ra trong kỳ trả lãi đầu tiên, giá gộp lãi được xác định theo công thức sau:

$$GG = G - Cx - MG \times Rc \times (D2/E1+1)$$

Trong đó:

- E1: Số ngày trong kỳ trả lãi trái phiếu thông thường theo giả định có ngày phát hành trái phiếu lần đầu diễn ra
- D2: Số ngày từ ngày phát hành trái phiếu lần đầu đến ngày trả lãi danh nghĩa thông thường theo giả định tiếp theo gần nhất

c) Xác định giá gộp lãi trong trường hợp ngày thanh toán trùng với ngày trả lãi danh nghĩa

$$GG = G - MG \times Rc$$

II. CÁC HÌNH THỨC GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU

1. GIAO DỊCH MUA BÁN THÔNG THƯỜNG - OUTRIGHT

Xác định giá trị thanh toán

Giá trị thanh toán TPCP trong giao dịch mua bán thông thường được xác định theo công thức sau:

$$V = GM \times KL$$

Trong đó:

- V: Giá trị giao dịch
- GM: Giá thực hiện
- KL: Khối lượng TPCP giao dịch

2. GIAO DỊCH MUA BÁN LẠI - REPOS

2.1 Thời hạn giao dịch mua bán lại:

Tối thiểu 2 ngày, tối đa là 365 ngày

2.2 Xác định giá trị giao dịch lần một

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

Giá trị giao dịch lần một được xác định theo công thức sau:

$$V_1 = GM \times KL$$

Trong đó:

- V_1 : Giá trị giao dịch lần một.
- KL : Khối lượng TPCP giao dịch
- GM : Giá thực hiện

2.3 Xác định lãi mua bán lại

a) Trường hợp không thay đổi lãi suất mua bán lại và thời hạn giao dịch

Lãi mua bán lại được xác định theo công thức sau:

$$L = V_1 \times R \times \frac{T}{\text{Số ngày thực tế của năm}}$$

Trong đó:

- L : Lãi mua bán lại
- R : Lãi suất mua bán lại (%/năm)
- T : Thời hạn giao dịch mua bán lại. Trường hợp thay đổi thời hạn giao dịch, T được tính theo số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày thanh toán giao dịch lần hai mới.
- Số ngày thực tế của năm: Là số ngày thực tế của năm có ngày thanh toán giao dịch lần 1.

b) Trường hợp thay đổi lãi suất mua bán lại và/hoặc thời hạn giao dịch

Lãi mua bán lại được xác định theo công thức sau:

$$L = \sum_{i=1}^{n+1} L_i$$

Trong đó:

- L : Lãi mua bán lại
- n : Số lần sửa lãi suất mua bán lại hoặc thời hạn giao dịch. Nếu sửa đồng thời cả lãi suất mua bán lại và thời hạn giao dịch thì được tính là 01 lần sửa.
- L_i : Lãi mua bán lại tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần $i-1$ đến ngày sửa lần thứ i

(L_1 : Lãi mua bán lại tính trong khoảng thời gian từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất; L_{n+1} : Lãi mua bán lại tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai).

L_i được tính theo công thức sau:

$$L_1 = V_1 \times R \times \frac{T_1}{\text{Số ngày thực tế của năm}} \quad (\text{với } i = 1)$$

$$L_i = \left(V_1 + \sum_{k=1}^{i-1} L_k \right) \times R_{i-1} \times \frac{T_i}{\text{Số ngày thực tế của năm}_{i-1}} \quad (\text{với } i \geq 2)$$

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

Trong đó:

- Ri-1: Lãi suất mua bán lại của lần sửa thứ i -1 (%/năm)
- Ti: Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ i-1 đến ngày sửa lần thứ i (T1 : Số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất;
- Tn+1: Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai)
- Số ngày thực tế của nămi-1: Là số ngày thực tế của năm có ngày sửa lần thứ i-1

2.4 Xác định giá trị giao dịch lần hai

Giá trị giao dịch lần hai được xác định theo công thức sau:

$$V2 = V1 + L - CPN - RND - \text{Lãi phạt}$$

Trong đó:

- V2: Giá trị giao dịch lần hai (làm tròn đến 01 đồng)
- L: Lãi mua bán lại
- CPN: Lãi coupon và lãi trên lãi coupon phát sinh trong thời hạn giao dịch (nếu có)
- RND: Số tiền phát sinh từ việc làm tròn lô trái phiếu tương đương (nếu có)
- Lãi phạt: Lãi phạt khi sử dụng trái phiếu tương đương (nếu có)

3. GIAO DỊCH VAY TRÁI PHIẾU -SBL

3.1 Thời hạn giao dịch mua bán lại:

Tối thiểu là 1 ngày, tối đa là 365 ngày

3.2 Xác định giá trị trái phiếu vay

Giá trị trái phiếu vay được xác định theo công thức sau:

$$V = GM \times KL$$

Trong đó:

- V: Giá trị trái phiếu vay
- GM: Giá thực hiện của trái phiếu vay
- KL: Khối lượng vay trái phiếu

3.3 Xác định lãi vay trái phiếu

a) Trường hợp không thay đổi lãi suất vay trái phiếu và thời hạn vay

Lãi vay trái phiếu được xác định theo công thức sau:

$$LV = V \times R_v \times \frac{T}{\text{Số ngày thực tế của năm}}$$

Trong đó:

- LV: Lãi vay trái phiếu
- Rv: Lãi suất vay trái phiếu (%/năm)

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

- T: Thời hạn vay trái phiếu. Trường hợp thay đổi thời hạn giao dịch, T được tính theo số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày thanh toán giao dịch lần hai mới.
- Số ngày thực tế của năm: Là số ngày thực tế của năm có ngày thanh toán giao dịch lần 1.

b) Trường hợp thay đổi lãi suất vay trái phiếu và/hoặc thời hạn vay

Lãi vay trái phiếu được xác định theo công thức sau:

$$LV = \sum_{i=1}^{n+1} LV_i$$

Trong đó:

- LV: Lãi vay trái phiếu
- n: Số lần sửa lãi suất vay trái phiếu hoặc thời hạn vay. Nếu sửa đồng thời cả lãi suất vay và thời hạn vay thì được tính là 01 lần sửa
- LV_i: Lãi vay trái phiếu tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần i-1 đến ngày sửa lần thứ i (LV₁: Lãi vay trái phiếu tính trong khoảng thời gian từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất; LV_{n+1}: Lãi vay trái phiếu tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai)
- LV_i - Lãi vay trái phiếu được tính theo công thức sau:

$$LV_1 = V \times R_v \times \frac{T_1}{\text{Số ngày thực tế của năm}} \quad (\text{với } i = 1)$$

$$LV_i = V \times R_{v,i-1} \times \frac{T_i}{\text{Số ngày thực tế của năm}_{i-1}} \quad (\text{với } i \geq 2)$$

Trong đó:

- R_{v,i-1}: Lãi suất vay trái phiếu của lần sửa thứ i-1 (%/năm)
- T_i: Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ i-1 đến ngày sửa lần thứ i (T₁: số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất; T_{n+1}: Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai)
- Số ngày thực tế của năm_{i-1}: Là số ngày thực tế của năm có ngày sửa lần thứ i-1

3.4 Tài sản đảm bảo

- Tài sản đảm bảo trong giao dịch vay trái phiếu là tiền
- Tỷ lệ tài sản đảm bảo trên giá trị vay là tỷ lệ giữa số tiền được dùng làm tài sản đảm bảo và giá trị trái phiếu vay do các bên trong giao dịch tự thỏa thuận
- Xác định giá trị tài sản đảm bảo

Giá trị tài sản đảm bảo được xác định theo công thức sau:

$$V = V \times H$$

Trong đó:

- V1: Giá trị tài sản đảm bảo (làm tròn đến 01 đồng)
- H: Tỷ lệ tài sản đảm bảo trên giá trị vay (%)

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

3.5 Xác định lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo

a) Trường hợp không thay đổi lãi suất tính trên tài sản đảm bảo và thời hạn giao dịch

Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo được xác định theo công thức sau:

$$L = V_1 \times R \times \frac{T}{\text{Số ngày thực tế của năm}}$$

Trong đó:

- L: Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo
- R: Lãi suất tính trên tài sản đảm bảo (%/năm)
- T: Thời hạn vay trái phiếu. Trường hợp thay đổi thời hạn giao dịch, T được tính theo số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày thanh toán giao dịch lần hai mới.
- Số ngày thực tế của năm: Là số ngày thực tế của năm có ngày thanh toán giao dịch lần 1.

b) Trường hợp thay đổi lãi suất tính trên tài sản đảm bảo và/hoặc thời hạn giao dịch

Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo được xác định theo công thức sau:

$$L = \sum_{i=1}^{n+1} L_i$$

Trong đó:

n: Số lần sửa lãi suất tính trên tài sản đảm bảo hoặc thời hạn giao dịch. Nếu sửa đồng thời cả lãi suất và thời hạn giao dịch thì được tính là 01 lần sửa

L_i : Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần $i-1$ đến ngày sửa lần thứ i (L_1 : Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo tính trong khoảng thời gian từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất; L_{n+1} : Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo tính trong khoảng thời gian từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai).

• **L_i** được tính theo công thức sau:

$$L_1 = V_1 \times R \times \frac{T_1}{\text{Số ngày thực tế của năm}} \quad (\text{với } i = 1)$$

$$L_i = \left(V_1 + \sum_{k=1}^{i-1} L_k \right) \times R_{i-1} \times \frac{T_i}{\text{Số ngày thực tế của năm}_{i-1}} \quad (\text{với } i \geq 2)$$

Trong đó:

- R_{i-1} : Lãi suất tính trên tài sản đảm bảo của lần sửa thứ $i-1$ (%/năm)
- T_i : Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ $i-1$ đến ngày sửa lần thứ i (T_1 : số ngày thực tế từ ngày thanh toán của giao dịch lần một đến ngày sửa lần thứ nhất;
- T_{n+1} : Số ngày thực tế từ ngày sửa lần thứ n đến ngày thanh toán của giao dịch lần hai)
- Số ngày thực tế của năm $i-1$: Là số ngày thực tế của năm có ngày sửa lần thứ $i-1$

3.6 Xác định giá trị hoàn trả tài sản đảm bảo

Giá trị hoàn trả tài sản đảm bảo được xác định theo công thức sau:

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

$$V2 = V1 + L - LV - CPN - RND - \text{Lãi phạt}$$

Trong đó:

- V2: Giá trị hoàn trả tài sản đảm bảo (làm tròn đến 01 đồng)
- L: Lãi phát sinh trên tài sản đảm bảo
- LV: Lãi vay trái phiếu
- CPN: Lãi coupon và lãi trên lãi coupon phát sinh trong thời hạn giao dịch (nếu có)
- RND: Số tiền phát sinh từ việc làm tròn lô trái phiếu tương đương (nếu có)
- Lãi phạt: Lãi phạt khi sử dụng trái phiếu tương đương (nếu có)

4. GIAO DỊCH BÁN KẾT HỢP MUA LẠI - SBB

4.1 Giao dịch bán kết hợp mua lại

- Giao dịch bán kết hợp mua lại bao gồm một giao dịch bán TPCP (giao dịch thông thường thứ nhất) kết hợp với một giao dịch mua lại cùng TPCP đó hoặc trái phiếu tương đương có thể chuyển giao theo thỏa thuận giữa các bên (giao dịch thông thường thứ 2) tại một thời điểm xác định trong tương lai.
- Các thông tin về giá, khối lượng, thời điểm thực hiện của giao dịch thông thường thứ 2 phải được xác định trước tại thời điểm giao kết hai giao dịch.
- Ngày thanh toán của giao dịch thông thường thứ 2 phải sau ngày thanh toán của giao dịch thông thường thứ 1 tối thiểu 01 ngày và tối đa là 365 ngày.

4.2. Xác định giá trị giao dịch lần một

Giá trị giao dịch lần một được xác định theo công thức sau:

$$V1 = GM1 \times KL$$

Trong đó:

- V1: Giá trị giao dịch lần một
- GM1: Giá thực hiện lần một
- KL: Khối lượng TPCP giao dịch

4.3. Xác định giá trị giao dịch lần hai

Giá trị giao dịch lần hai được xác định theo công thức sau:

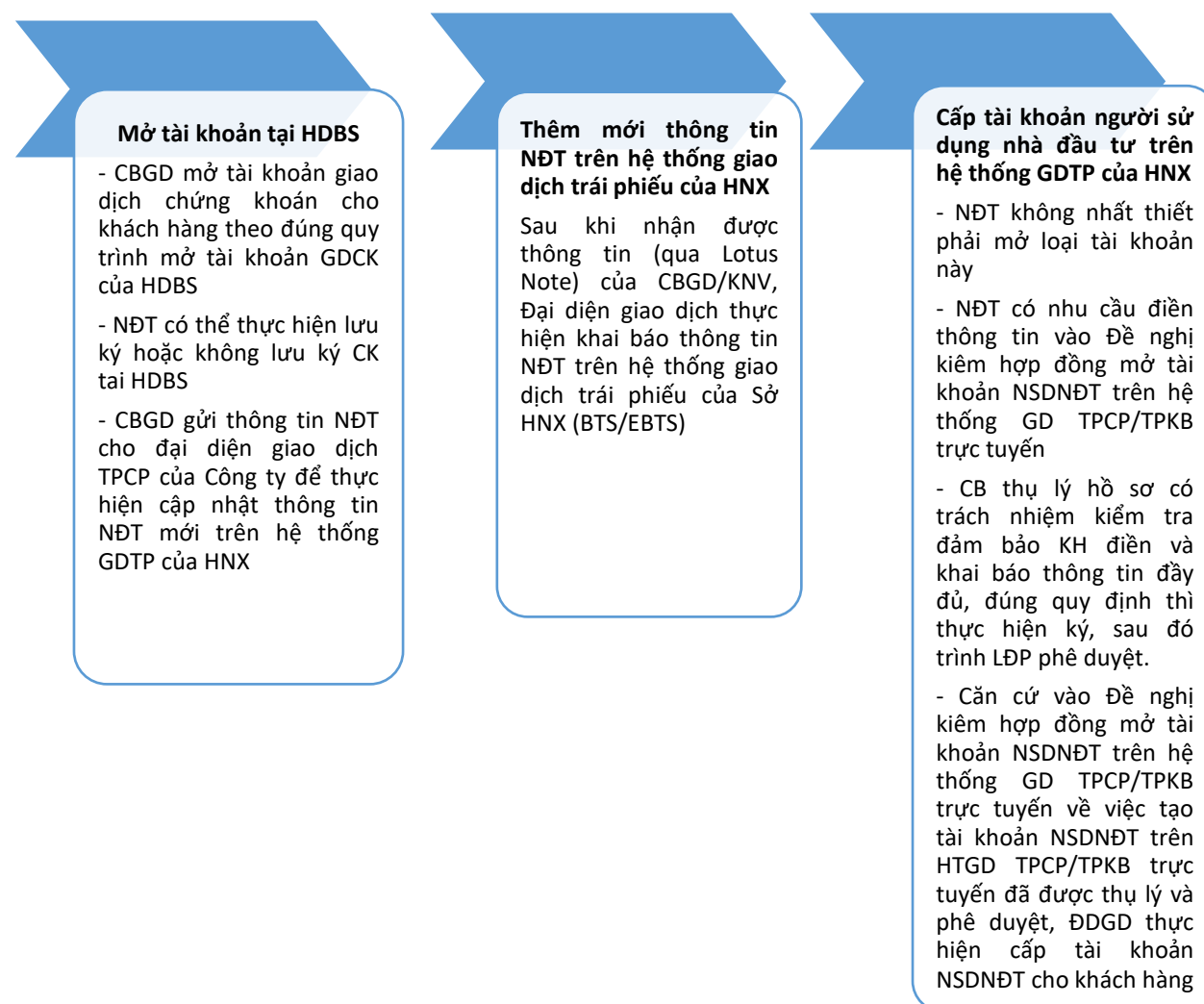
$$V2 = GM2 \times KL - RND - \text{Lãi phạt}$$

Trong đó:

- V2: Giá trị giao dịch lần hai (làm tròn đến 01 đồng)
- GM2: Giá thực hiện lần hai
- RND: Số tiền phát sinh từ việc làm tròn lô trái phiếu tương đương (nếu có)
- Lãi phạt: Lãi phạt khi sử dụng trái phiếu tương đương (nếu có)

III. QUY TRÌNH GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU

1. QUY TRÌNH MỞ TÀI KHOẢN CHO NĐT GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU



2. QUY ĐỊNH VỀ CẬP NHẬT VÀ KIỂM SOÁT SỐ DƯ TPCP/TPKB TRÊN HỆ THỐNG GIAO DỊCH TPCP/TPKB CỦA HNX

2.1. Cập nhật số dư TPCP/TPKB của Nhà đầu tư không thông qua giao dịch

Cập nhật số dư TP của NĐT không thông qua giao dịch bao gồm:

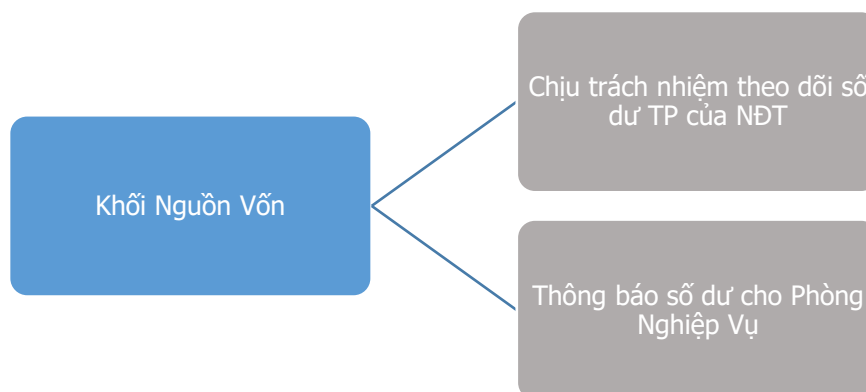
- Cập nhật lần đầu: Sau khi hoàn tất việc đăng ký thông tin Nhà đầu tư trên Hệ thống giao dịch TPCP của HNX, ĐDGD có trách nhiệm cập nhật số dư TP của Nhà đầu tư lên Hệ thống giao dịch TPCP của HNX.
- Cập nhật tăng giảm số dư TP của Nhà đầu tư phát sinh không thông qua giao dịch và đấu thầu lên hệ thống GD TP của HNX
- Việc cập nhật số dư TPCP/TPKB của Nhà đầu tư phải đảm bảo đúng theo số liệu có xác nhận của cơ quan quản lý theo quy định và theo quy trình của HDBS.

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

2.2 Cập nhật tăng giảm số dư TP của Nhà đầu tư phát sinh thông qua giao dịch TPCP của HNX trên Hệ thống giao dịch TP của HNX hoặc thông qua hình thức đấu thầu tại SGDCKHN

Việc cập nhật này được Hệ thống GD TP của HNX tự động hạch toán tăng/giảm số dư TP khi có kết quả thanh toán bù trừ

2.3 Quy trình cập nhật số dư TP lên hệ thống giao dịch của HNX

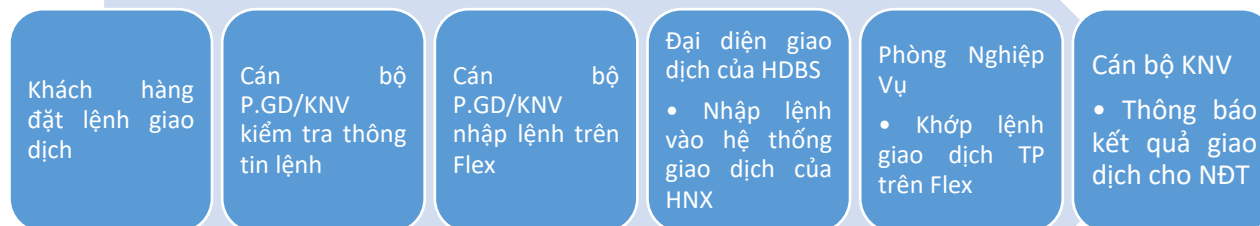


3. TRA CỨU THÔNG TIN VỀ TRÁI PHIẾU TRÊN HỆ THỐNG GIAO DỊCH TPCP CỦA HNX

Đại diện giao dịch được phân công tại KNV Công ty, Phòng Nghiệp Vụ có thể tra cứu trên hệ thống giao dịch TPCP của HNX những thông tin sau:

- Tra cứu danh mục trái phiếu
- Thông tin về trái phiếu giao dịch: mã TP, kỳ hạn TP, kỳ hạn còn lại, lịch trả lãi, lãi suất...
- Thông tin lịch giao dịch
- Số dư TPCP/TPKB của nhà đầu tư
- Tra cứu những giao dịch phát sinh làm tăng giảm số dư TPCP/TPKB
- Tra cứu sổ lệnh giao dịch outright, repo SBB trong ngày/tương lai...
- Các loại báo cáo lệnh giao dịch thông thường, giao dịch mua bán lại lần 2, danh sách lệnh giao dịch mua bán lại lần 2 đến hạn, danh sách giao dịch lần 2 chưa đến hạn thanh toán...
- Tra cứu danh sách người sử dụng trên hệ thống
-

4. QUY TRÌNH NHẬN LỆNH GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU



4. QUY TRÌNH NHẬN LỆNH GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU

4.1 Khách hàng đặt lệnh giao dịch

4.1.1. Khách hàng có thể đặt lệnh giao dịch dưới các hình thức:

- Trực tiếp
- Qua email
- Qua tài khoản NSDNĐT
- Qua EMSX Bloomberg
- Qua FIX net

4.1.2 Giao dịch qua điện thoại

Khách hàng thực hiện giao dịch chứng khoán qua điện thoại bằng cách:

Gọi đến số điện thoại (84.28) 7307 6966 , Quý khách sẽ được nghe hướng dẫn của hệ thống.

Quý khách làm theo hướng dẫn của hệ thống, nhấn phím 1 để đặt lệnh. Cuộc gọi của Quý khách sẽ được chuyển đến hệ thống nhận lệnh và gặp trực tiếp với nhân viên giao dịch, Quý khách cần cung cấp các thông tin sau: + Họ và tên chủ tài khoản, Mã tài khoản, Số CMND.

+ Mật khẩu đặt lệnh qua điện thoại.

Nếu Quý khách cung cấp chính xác các thông tin về bảo mật, thì Quý khách sẽ được nhân viên nhận lệnh yêu cầu cung cấp tiếp các thông tin: Lệnh mua/bán/hủy/sửa, Mã cổ phiếu, Số lượng, Giá. Sau đó nhân viên nhận lệnh sẽ kiểm tra số dư tiền hoặc số dư chứng khoán và tiến hành đặt lệnh vào hệ thống nếu phù hợp.

Nếu Khách hàng không cung cấp chính xác các thông tin bảo mật, thì khách hàng sẽ được hỏi lại một lần nữa, nếu Quý khách vẫn không cung cấp đúng thông tin thì cuộc gọi sẽ được kết thúc.

Toàn bộ thông tin đặt lệnh qua điện thoại sẽ được ghi âm và lưu trữ tại HDBS.

+ Để đảm bảo tính bảo mật, khách hàng nên thường xuyên liên hệ với Nhân viên Môi giới để thay đổi mật khẩu và không được tiết lộ những thông tin bảo mật. HDBS sẽ không chịu trách nhiệm trong trường hợp khách hàng để lộ những thông tin bảo mật.

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

+ Khi muốn ngừng giao dịch chứng khoán qua điện thoại, Quý khách vui lòng liên hệ với Bộ phận môi giới của HDBS để làm thủ tục hủy đăng ký giao dịch qua điện thoại.

4.2 Cán bộ KNV kiểm tra thông tin lệnh

- Thông tin khách hàng trên lệnh: đảm bảo tính chính xác về tên khách hàng, CMT, email đã đăng ký đặt lệnh, mật khẩu đặt lệnh qua điện thoại... Đối với lệnh trực tiếp đảm bảo đúng KH là người khai thông tin và ký trên phiếu lệnh
- Thông tin lệnh đặt: mã CK, số lượng, giá đặt.. theo quy định của các Sở GDCK và HDBS

4.3 Cán bộ KNV nhập lệnh trên phần mềm Flex**4.4 Đại diện giao dịch của HDBS nhập lệnh vào hệ thống giao dịch của HNX**

- Đại diện giao dịch sau khi nhận được thông tin lệnh từ CBGD nhập lệnh theo Quy trình giao dịch TPCP và phân công công việc của HDBS
- Các phương thức nhập lệnh giao dịch TP vào hệ thống giao dịch của HNX:
 - Nhập lệnh vào hệ thống giao dịch từ xa (BTS)
 - Nhập lệnh vào hệ thống giao dịch trực tuyến (EBTS)
 - Ngoài ra, trong những trường hợp lỗi đường truyền kết nối với HNX, hoặc trong trường hợp bất khả kháng không thể nhập lệnh tại HDBS, ĐGDGD thực hiện nhập lệnh tại Sở HNX

4.5 Phòng Nghiệp Vụ khớp lệnh giao dịch TP trên Flex

- Sau khi hoàn thành nhập lệnh giao dịch trái phiếu trên hệ thống giao dịch TPCP của Sở HNX, cán bộ các Phòng giao dịch, KNV thông báo cho Phòng Nghiệp Vụ qua Lotus Notes hoặc điện thoại nội bộ về thông tin lệnh trái phiếu trong ngày.
- Phòng Nghiệp Vụ thực hiện khớp lệnh trên hệ thống Flex
- Phòng Nghiệp Vụ thông báo lại về việc hoàn thành khớp lệnh giao dịch TP cho các /KNV có lệnh qua Lotus Notes hoặc điện thoại nội bộ

4.6 Cán bộ KNV thông báo kết quả giao dịch cho NĐT

- Sau khi nhận được thông báo từ Phòng Nghiệp Vụ về hoàn thành việc khớp lệnh, cán bộ KNV kiểm tra báo cáo trên hệ thống Flex
- Cán bộ KNV gửi thông báo kết quả khớp lệnh giao dịch cho khách hàng

5. QUY TRÌNH SỬA HỦY LỆNH GIAO DỊCH TRÁI PHIẾU**5.1 Đối với lệnh chưa thực hiện****a) Sửa lệnh thỏa thuận chưa thực hiện**Các giao dịch áp dụng:

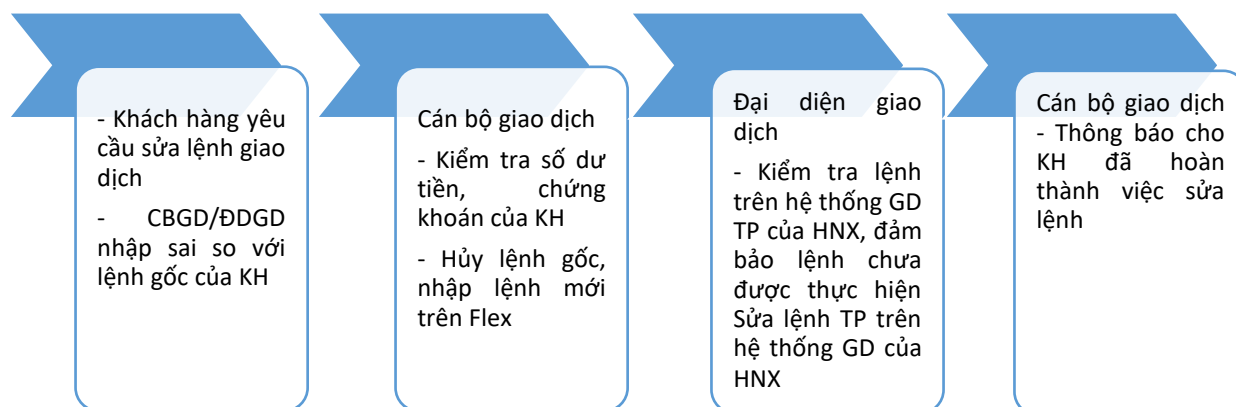
- Tất cả các giao dịch: outright, repo, SBB đều thực hiện sửa lệnh chưa thực hiện theo quy trình này

Nội dung sửa lệnh:

- ĐGDGD/NĐT không được sửa thông tin Thị trường của lệnh
- ĐGDGD/NĐT được sửa tất cả các thông tin còn lại của lệnh: loại lệnh Mua/Bán, số lượng, giá thực hiện, thành viên đối tác, tài khoản nhà đầu tư....

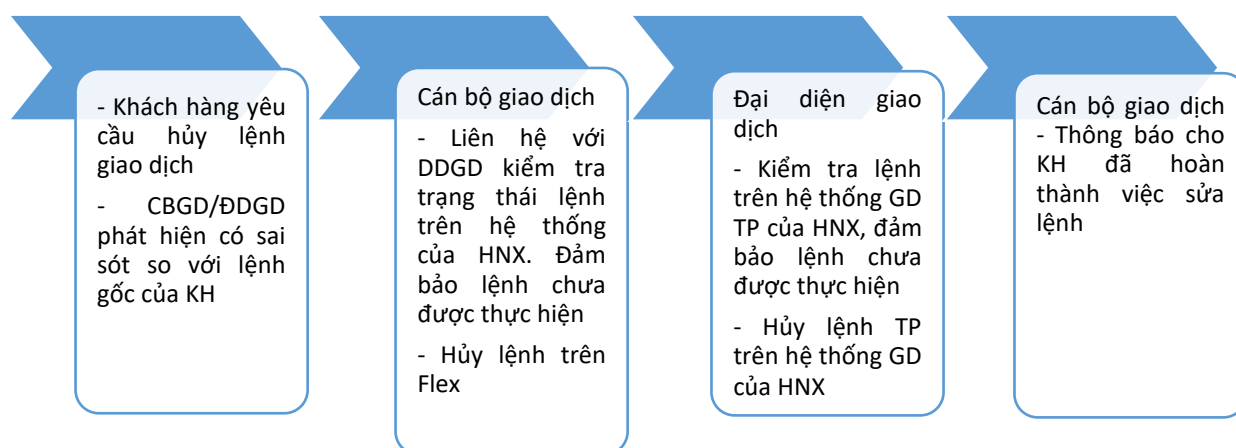
Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

Quy trình sửa lệnh giao dịch trái phiếu chưa thực hiện



Hủy lệnh thỏa thuận chưa thực hiện

Tất cả các giao dịch: outright, repo, SBB đều thực hiện hủy lệnh chưa thực hiện theo quy trình này



5.2 Đối với lệnh đã thực hiện

5.2.1 Sửa/hủy lệnh đã thực hiện chưa gửi vào hệ thống BTS

■ Nội dung nghiệp vụ

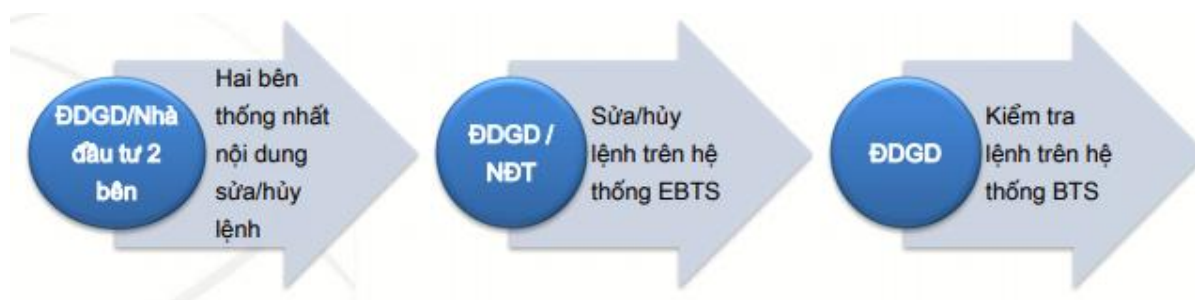
Sửa/hủy lệnh đã thực hiện Outright, Repo, SBB trên hệ thống EBTS chưa gửi vào hệ thống BTS.

■ Nội dung sửa lệnh:

Ngoại trừ các thông tin Mua/Bán, thông tin thị trường và thông tin thành viên đối tác,

ĐDGD/NĐT có thể sửa tất cả thông tin còn lại đã thỏa thuận trên lệnh

Quy trình sửa/hủy lệnh



5.2.2 Sửa/hủy lệnh ĐTH trong ngày đã gửi vào hệ thống BTS

■ Nội dung nghiệp vụ

Sửa giao dịch Outright và giao dịch Repo, SBB lần 1 thực hiện trong ngày và đã gửi lệnh vào Hệ thống BTS

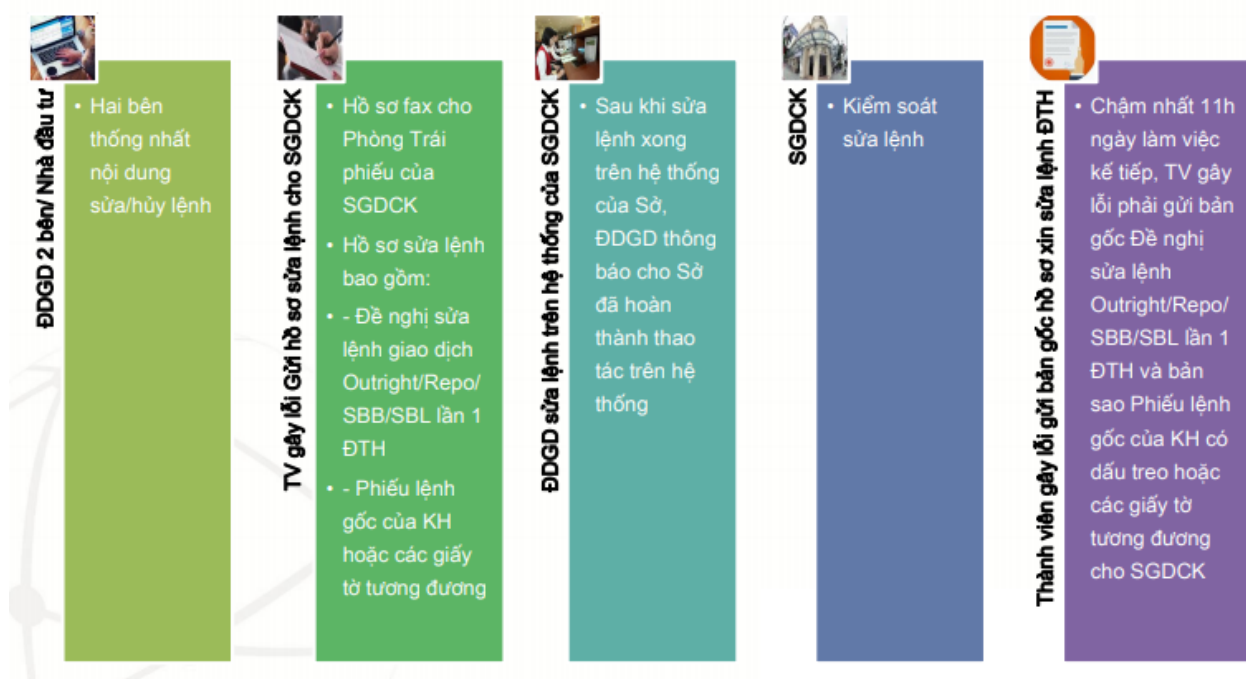
■ Thời điểm thực hiện:

- Đối với sửa lệnh đã thực hiện trong giờ giao dịch: thời gian sửa lệnh đã thực hiện phải hoàn tất chậm nhất 10 phút trước khi phiên giao dịch kết thúc
- Đối với sửa lệnh sau giờ giao dịch: Thời gian sửa lệnh đã thực hiện phải hoàn tất chậm nhất 10 phút sau khi phiên giao dịch kết thúc

■ Nội dung sửa lệnh:

Ngoại trừ các thông tin Mua/Bán, thông tin thị trường và thông tin thành viên đối tác, ĐDGD/NĐT có thể sửa tất cả thông tin còn lại đã thỏa thuận trên lệnh

■ Quy trình sửa/hủy lệnh Outright/Repo/SBB lần 1 ĐTH trong ngày đã gửi vào hệ thống BTS



5.2.3 Sửa/hủy Lệnh giao dịch lần 2

Nội dung nghiệp vụ

Sửa giao dịch Repo, SBB lần 2 chưa đến hạn thanh toán hoặc đến hạn thanh toán trong ngày

Thời điểm thực hiện

- Đối với sửa lệnh đã thực hiện trong giờ giao dịch: thời gian sửa lệnh đã thực hiện phải hoàn tất chậm nhất 10 phút trước khi phiên giao dịch kết thúc
- Đối với sửa lệnh sau giờ giao dịch: thời gian sửa lệnh đã thực hiện phải hoàn tất chậm nhất 10 phút sau khi phiên giao dịch kết thúc

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

Nội dung sửa lệnh giao dịch lần 2:

Giao dịch Repos

- Lãi suất Repos
- Kỳ hạn Repos
- Lãi suất trên lãi coupon (nếu có)
- Trái phiếu tương đương: hai bên thống nhất để chọn mới danh sách TPTĐ hoặc chọn thanh toán bằng TPTĐ

Giao dịch SBB

- Giá yết lần 2
- Ngày kết thúc giao dịch
- Trái phiếu tương đương: hai bên thống nhất để chọn mới danh sách TPTĐ hoặc chọn thanh toán bằng TPTĐ

Quy trình sửa lệnh giao dịch lần 2 với giao dịch Repos/ SBB



5.2.4 Sửa/hủy lệnh ĐTH tương lai đã gửi vào hệ thống BTS

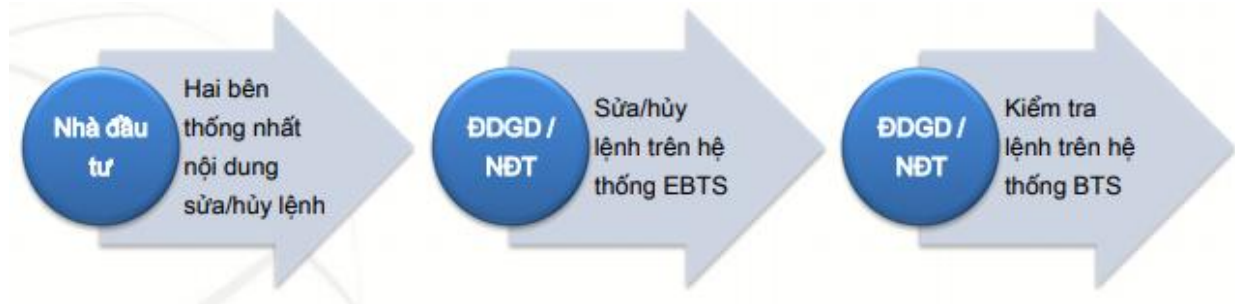
■ Nội dung nghiệp vụ

Sửa/ hủy lệnh tương lai đã thực hiện đã gửi vào hệ thống BTS, do hai bên đối tác Mua và Bán tự thỏa thuận với nhau

■ Nội dung sửa lệnh:

Ngoại trừ các thông tin Mua/Bán, thông tin thị trường và thông tin thành viên đối tác, ĐGD/NĐT có thể sửa tất cả thông tin còn lại đã thỏa thuận trên lệnh

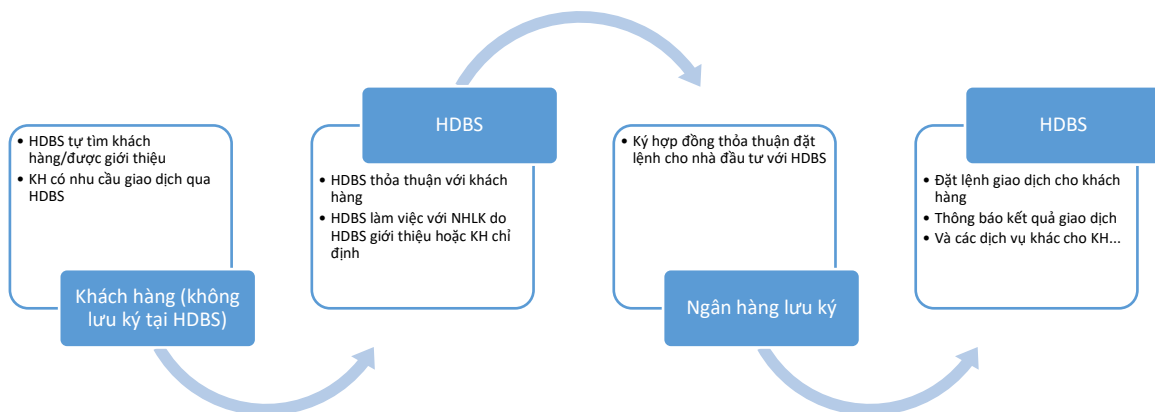
■ Quy trình sửa/hủy lệnh ĐTH tương lai đã gửi vào BTS



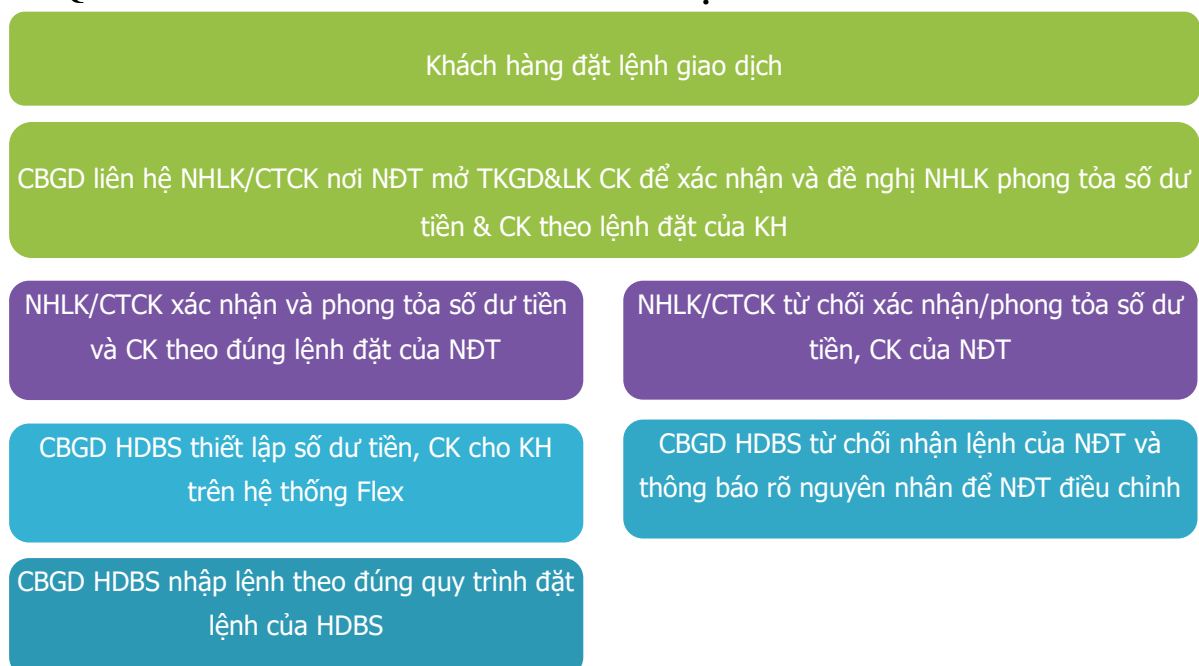
Khi quản lý tài khoản không lưu ký tại HDBS, cán bộ giao dịch cần chú ý những vấn đề sau:

- Tài khoản đó mở tại Ngân hàng lưu ký nào?
- Đầu mối liên hệ tại các Ngân hàng lưu ký đó?
- Hình thức xác nhận thông tin về tiền, chứng khoán: qua địa chỉ email hay số điện thoại đăng ký ?
- Cách thức xác nhận số dư: từng giao dịch của khách hàng, xác nhận số dư đầu ngày ?
- Cuối ngày giao dịch, CBGD in báo cáo giao dịch gửi NHLK -> NHLK chuyển tiền cho HDBS

IV. QUẢN LÝ TÀI KHOẢN KHÔNG LƯU KÝ TẠI HDBS



IV. QUẢN LÝ TÀI KHOẢN KHÔNG LƯU KÝ TẠI HDBS



- CBGD thiết lập số dư tiền và chứng khoán cho NĐT bằng các giao dịch sau:

STT	Mã giao dịch	Tên giao dịch	Đường dẫn	Mục đích
1	1187	Thiết lập hạn mức giao dịch cho tài khoản lưu ký nơi khác	Màn hình chính	Cấp tiền cho các tài khoản không lưu ký tại HDBS
2	2287	Thiết lập số dư chứng khoán cho tài khoản lưu ký nơi khác	Màn hình chính	Cấp chứng khoán cho các tài khoản không lưu ký tại HDBS

V. GIAO DỊCH QUA CÔNG KẾT NỐI ĐIỆN TỬ

Hiện nay, HDBS đã nâng cấp phần mềm trung gian theo chuẩn FIX cho phép nhận lệnh giao dịch của khách hàng trên các giao thức điện tử như:

- Bloomberg
- ITG
- Portware...

Tuy nhiên, tại tài liệu này chỉ đề cập đến hình thức giao dịch trên Bloomberg theo quy trình đã ban hành của HDBS.

GIAO DỊCH QUA CÔNG KẾT NỐI BLOOMBERG

1. MỘT SỐ THUẬT NGỮ TRONG GIAO DỊCH GIAO DỊCH BLOOMBERG

a) Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg

- Là tên gọi do KH lựa chọn để đặt và quy ước cho từng Tiểu khoản giao dịch chứng khoán
- Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg gồm 19 ký tự (xxxxxxxx-xxxxxxxxx). Trong đó 8 ký tự đầu tiên do Khách hàng lựa chọn, dấu gạch ngang (-), 10 ký tự sau là Số Tiểu khoản giao dịch chứng khoán của Khách hàng đăng ký tương ứng với Mã hiệu Tiểu khoản đó.
- Khách hàng có trách nhiệm khai báo Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg với HDBS. HDBS sẽ hỗ trợ KH khai báo kích hoạt việc đặt lệnh đến hệ thống GDCK của HDBS trên hệ thống Bloomberg. Khi đặt lệnh, Khách hàng sẽ lựa chọn Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg thay cho việc lựa chọn Số tiểu khoản GDCK để đặt lệnh. Tương ứng với Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg do Khách hàng lựa chọn, lệnh đặt sẽ được thực hiện trên Số Tiểu khoản GDCK tương ứng với Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg đó.

b) Trader ID

- Là chuỗi ký tự dạng số duy nhất tương ứng với tên người sử dụng truy cập Bloomberg của Khách hàng
- Khách hàng phải khai báo và đăng ký Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg và TraderID tương ứng

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

- TraderID là địa chỉ đưa ra các lệnh đặt và (hoặc) yêu cầu dịch vụ đối với từng Tiểu khoản giao dịch chứng khoán, tương ứng Mã hiệu Tiểu khoản trên Bloomberg và được chuyển đến Hệ thống giao dịch chứng khoán tại HDBS.

2. CÁC LOẠI LỆNH ĐẶT TỪ BLOOMBERG

2.1 Lệnh AUTO

- Lệnh AUTO là lệnh giao dịch chứng khoán được Khách hàng đặt từ Hệ thống Bloomberg và chuyển thẳng vào Hệ thống GDCK của các SGDCK với điều kiện Tài khoản lưu ký của Khách hàng có đủ số dư tiền/chứng khoán theo nội dung lệnh đặt.

- Nếu Tài khoản lưu ký của Khách hàng không có đủ số dư tiền/chứng khoán, Hệ thống Flex trả lại thông tin Tiểu khoản thiếu số dư cho Hệ thống Bloomberg. Trên Hệ thống Bloomberg lệnh bị từ chối (trạng thái lệnh hiển thị Assign), nguyên nhân từ chối được nêu rõ trong màn hình chi tiết lệnh của Khách hàng trên Bloomberg.

2.2 Lệnh MANUAL (MNL)

- Lệnh MANUAL là lệnh giao dịch chứng khoán của Khách hàng được đặt từ Hệ thống Bloomberg, chuyển qua đường truyền kết nối đến Hệ thống GDCK của HDBS và được chuyển cho CBQLTK.

Theo đó, Khách hàng ủy quyền cho CBQLTK, căn cứ nội dung lệnh đặt của Khách hàng (“Lệnh chỉ thị”), chủ động tiến hành chuyển lệnh giao dịch của Khách hàng vào Hệ thống GDCK của các Sở Giao dịch trên cơ sở theo dõi diễn biến thị trường trong ngày giao dịch và đảm bảo tuân thủ theo Lệnh chỉ thị.

- Việc chuyển lệnh của Khách hàng vào Hệ thống GDCK của các Sở Giao dịch phải đảm bảo:

- i. Tổng khối lượng khớp lệnh không vượt quá khối lượng của Lệnh chỉ thị và
- ii. Giá khớp trung bình không cao hơn giá chỉ thị với lệnh mua và không thấp hơn giá chỉ thị với lệnh bán.

2.3 Lệnh ANY

Lệnh ANY là lệnh giao dịch chứng khoán của Khách hàng đặt từ Hệ thống Bloomberg, chuyển qua đường truyền kết nối đến Hệ thống GDCK của HDBS và được chuyển cho CBQLTK.

Theo đó, Khách hàng ủy quyền cho CBQLTK, trên cơ sở theo dõi diễn biến thị trường trong ngày giao dịch và căn cứ nội dung lệnh đặt của KH, chủ động chuyển lệnh giao dịch của KH vào Hệ thống GDCK của các Sở Giao dịch trong vòng 30 phút kể từ khi nhận lệnh đặt.

Sau 30 phút, nếu toàn bộ khối lượng lệnh đặt chưa được chuyển hết vào Hệ thống GDCK của Sở Giao dịch, khối lượng lệnh đặt còn lại sẽ được tự động chuyển thành lệnh trực tiếp tại mức giá Khách hàng chỉ thị và được chuyển vào Hệ thống giao dịch của các Sở.

Sau 30 phút kể từ khi nhận lệnh đặt, thời hạn ủy quyền cho CBQLTK xử lý lệnh đặt hết hiệu lực, do đó Khách hàng muốn hủy/sửa các lệnh con do CBQLTK đã đặt và lệnh AUTO phát sinh trên cơ sở lệnh gốc ANY, KH phải đặt lệnh trực tiếp hoặc thông báo cho CBQLTK.

2.4 Lệnh Bloomberg EMSX

- Lệnh EMSX là lệnh giao dịch chứng khoán do Khách hàng đặt trên Hệ thống Bloomberg chuyển đến Cán bộ quản lý tài khoản thông qua việc hiển thị trên màn hình máy trạm Bloomberg.

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

- Theo đó, Khách hàng ủy quyền cho CBQLTK, căn cứ nội dung lệnh đặt của Khách hàng (“Lệnh chỉ thị”), chủ động tiến hành chuyển lệnh giao dịch vào Hệ thống giao dịch chứng khoán của các SGDCK trên cơ sở theo dõi diễn biến thị trường trong ngày giao dịch và đảm bảo tuân thủ theo Lệnh chỉ thị. Sau khi hoàn tất chuyển lệnh giao dịch vào Hệ thống GDCK của các SGDCK, CBQLTK thông báo kết quả giao dịch lại cho KH thông qua Hệ thống Bloomberg.

4. QUY TRÌNH KHAI BÁO/HỦY KHAI BÁO LUẬT ĐIỀU PHỐI LỆNH BLOOMBERG

■ Mục đích

Điều chỉnh phạm vi Cán bộ quản lý tài khoản được phép xử lý lệnh đặt của Khách hàng trong Hệ thống Bloomberg

■ Nội dung

- Mỗi luật điều phối lệnh Bloomberg có thể bao gồm một hoặc nhiều nội dung như sau:

(i) Khối lượng lệnh đặt nhỏ nhất;

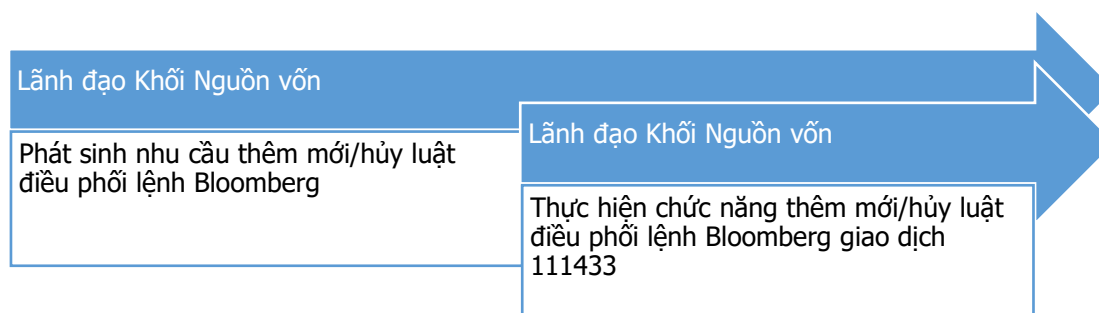
(ii) Tổng khối lượng lệnh đặt lớn nhất;

(iii) Loại lệnh: Mua, bán, bán khống, mua cover, bán cầm cố, hủy mua, hủy bán, sửa mua, sửa bán và

(iv) Mã chứng khoán: có thể chọn một hoặc nhiều mã cụ thể

- Các Luật điều phối lệnh Bloomberg do Khối Nguồn vốn chủ động tự khai báo khi phát sinh nhu cầu và từng luật này sẽ được gán cho các User đặt lệnh tương ứng với các CBQLTK trong Khối để đáp ứng yêu cầu quản lý điều phối lệnh theo các Luật điều phối đã được gán.

■ Quy trình

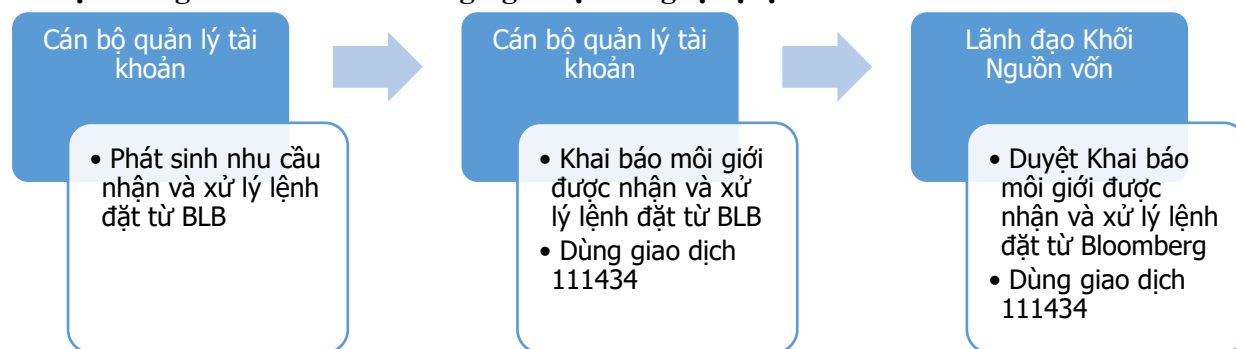


5. QUY TRÌNH ĐĂNG KÝ/HỦY ĐĂNG KÝ CBQLTK ĐƯỢC NHẬN VÀ XỬ LÝ LỆNH TỪ HỆ THỐNG

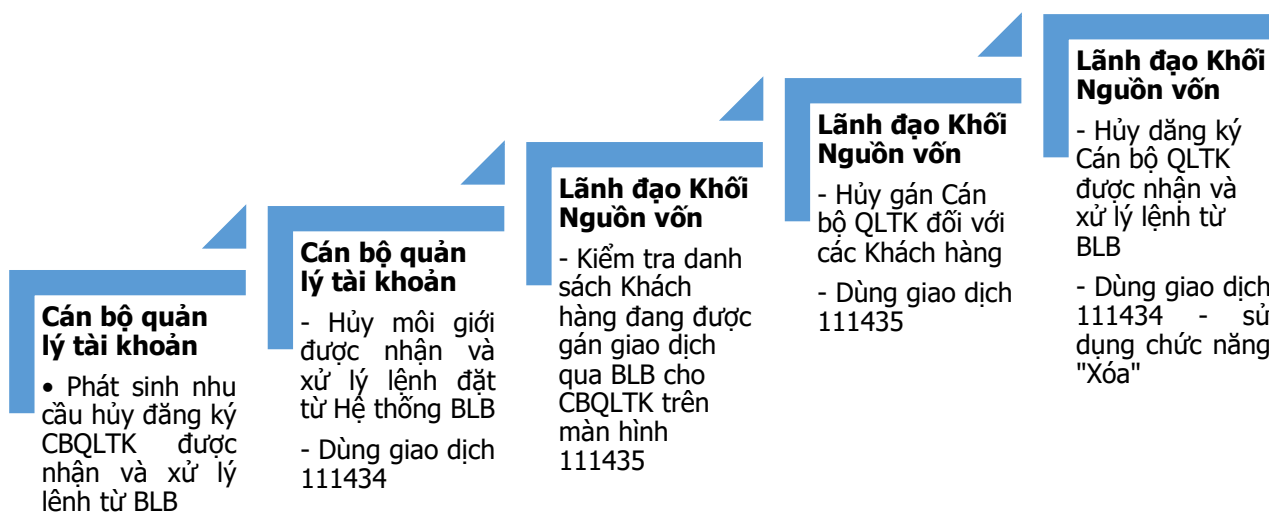
BLOOMBERG

5.1 Quy trình đăng ký CBQLTK được nhận và xử lý lệnh từ hệ thống Bloomberg

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

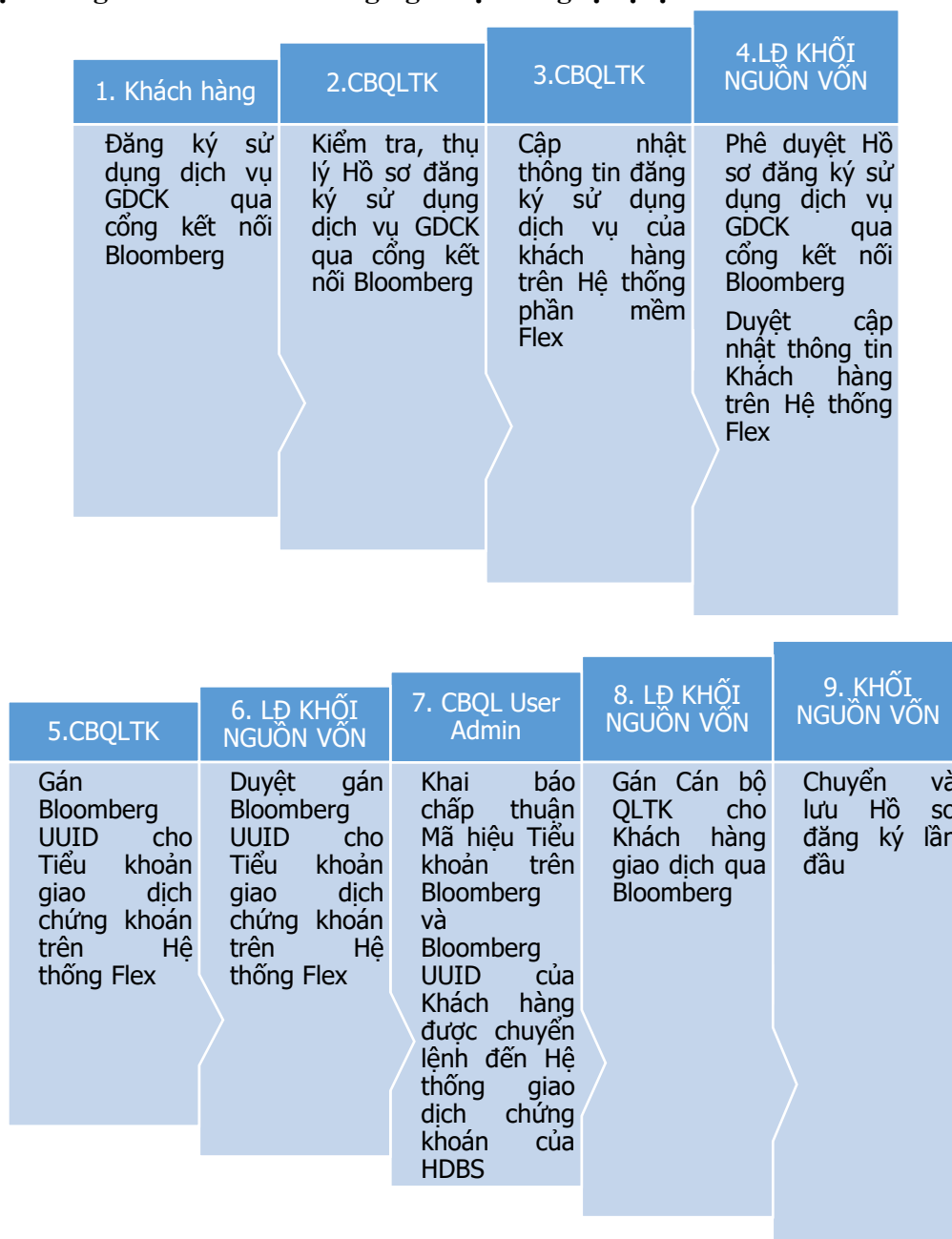


5.2 Quy trình hủy đăng ký CBQLTK được nhận và xử lý lệnh từ hệ thống Bloomberg



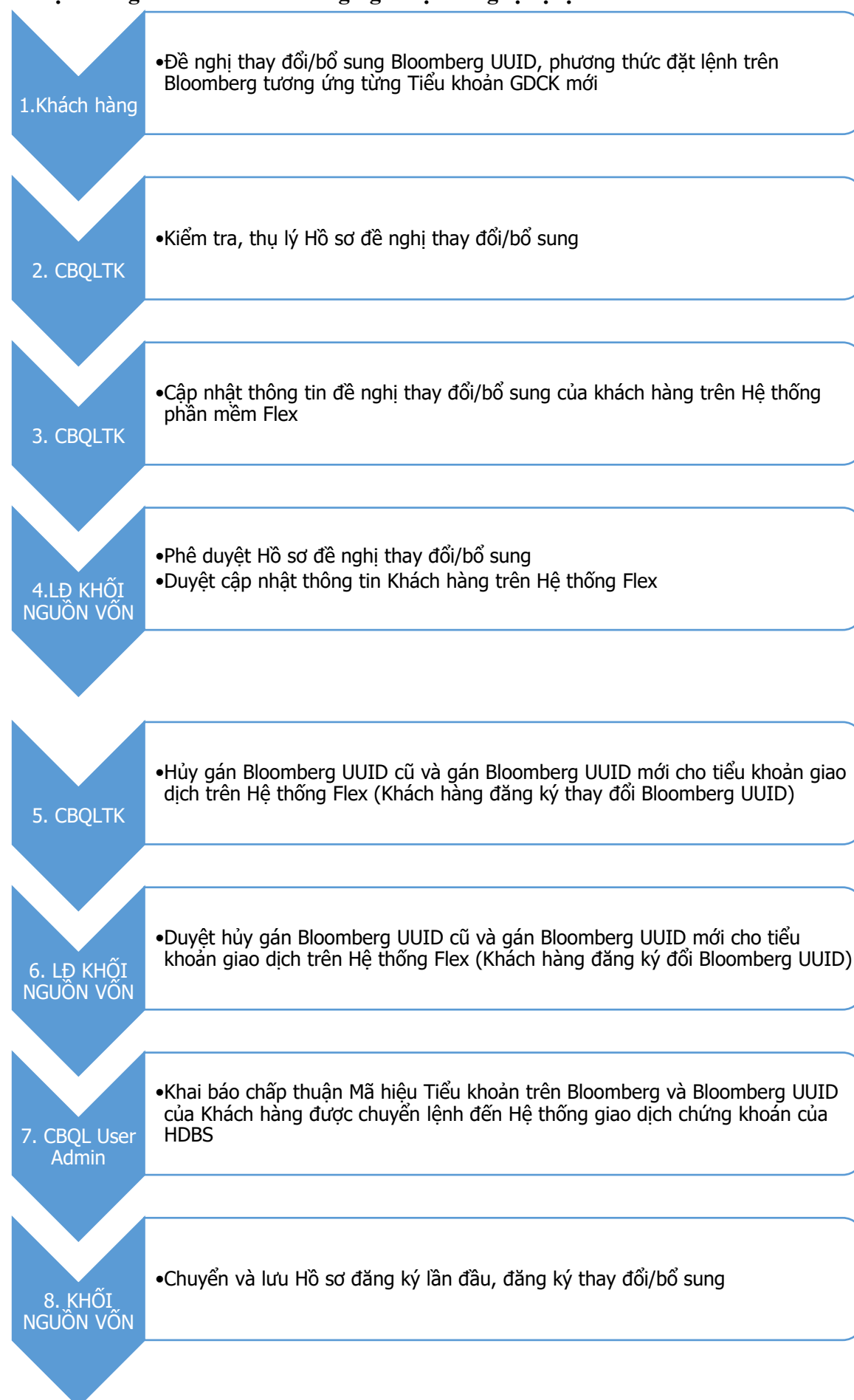
6. QUY TRÌNH ĐĂNG KÝ DỊCH VỤ GDCK QUA CỔNG KẾT NỐI BLOOMBERG.

- **Điều kiện:** Khách hàng mở Tài khoản giao dịch chứng khoán tại HDBS

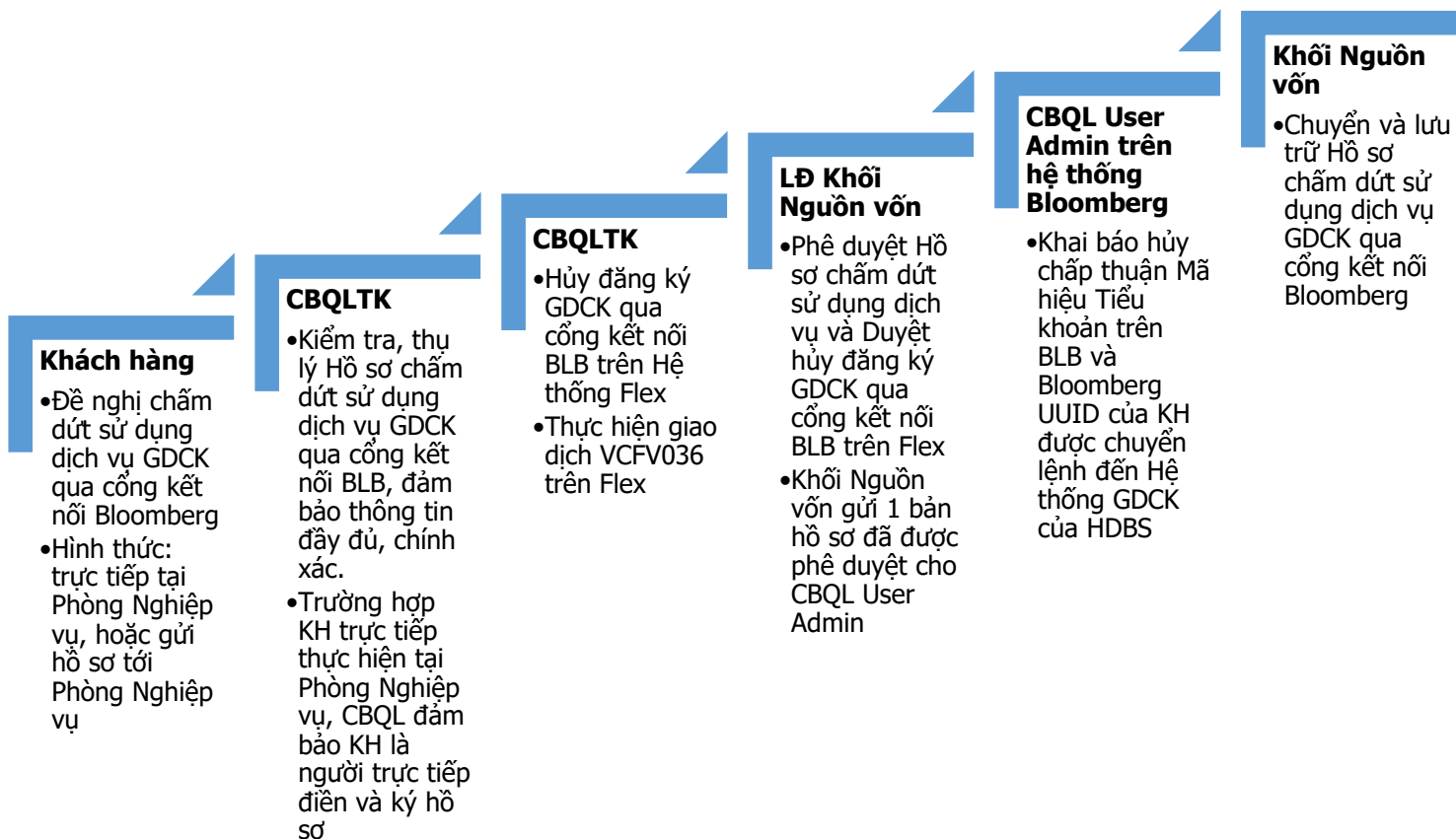


7. QUY TRÌNH THAY ĐỔI/BỔ SUNG DỊCH VỤ GDCK QUA CÖNG KẾT NỐI BLOOMBERG

- **Điều kiện:** Khách hàng mở Tài khoản giao dịch chứng khoán tại HDBS



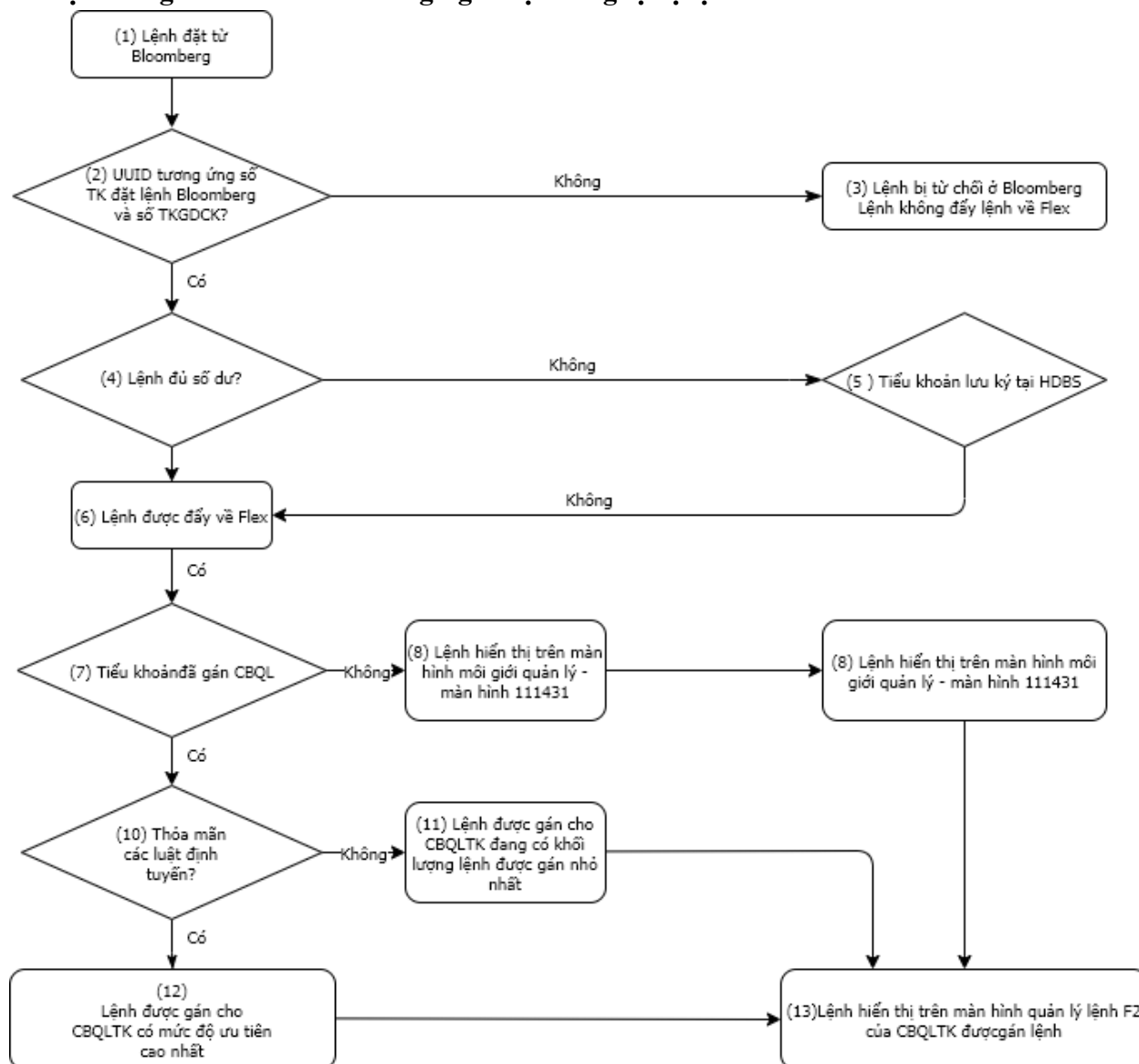
8. QUY TRÌNH CHẤM DỨT SỬ DỤNG DỊCH VỤ GDCK QUA CỐNG KẾT NỘI BLOOMBERG



9. QUY TRÌNH GÁN LỆNH ĐẶT TỪ BLOOMBERG CHO MÔI GIỚI

Khi Khách hàng đặt lệnh giao dịch chứng khoán trên Hệ thống Bloomberg, lệnh được tự động truyền đến cơ sở dữ liệu trong Hệ thống giao dịch chứng khoán của HDBS theo quy trình sau:

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

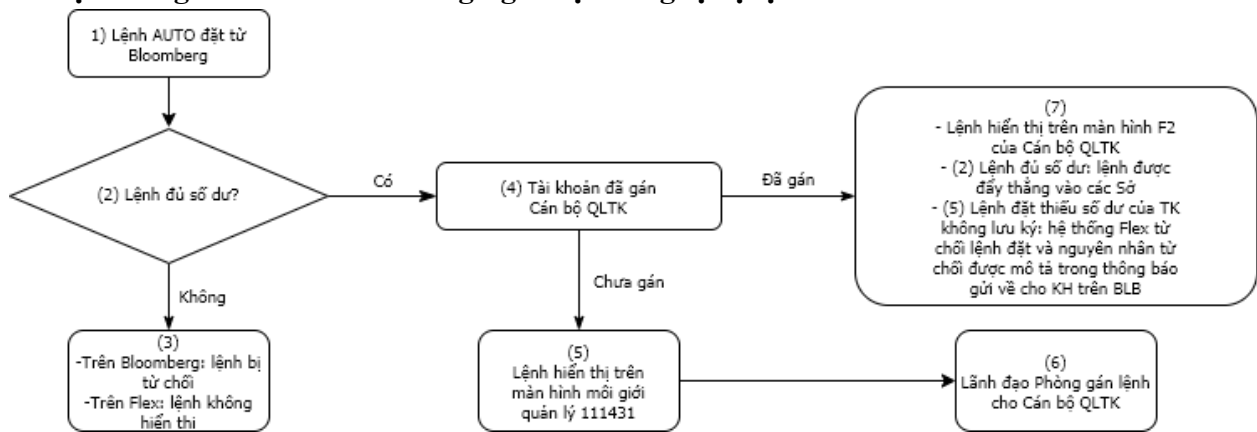


10. QUY TRÌNH QUẢN LÝ LỆNH ĐẶT TRÊN BLOOMBERG ĐỐI VỚI LỆNH ĐẶT TRỰC TIẾP VÀO SÀN GIAO DỊCH (LỆNH AUTO)

Khi khách hàng chọn lệnh AUTO trên BLB để đặt tới HDBS, khách hàng có thể đặt tất cả các loại lệnh theo quy định của các SGDCK, bao gồm:

- Lệnh LO
- Lệnh ATO
- Lệnh ATC
- Lệnh MP
- Lệnh MTL
- Lệnh MOK
- Lệnh MAK

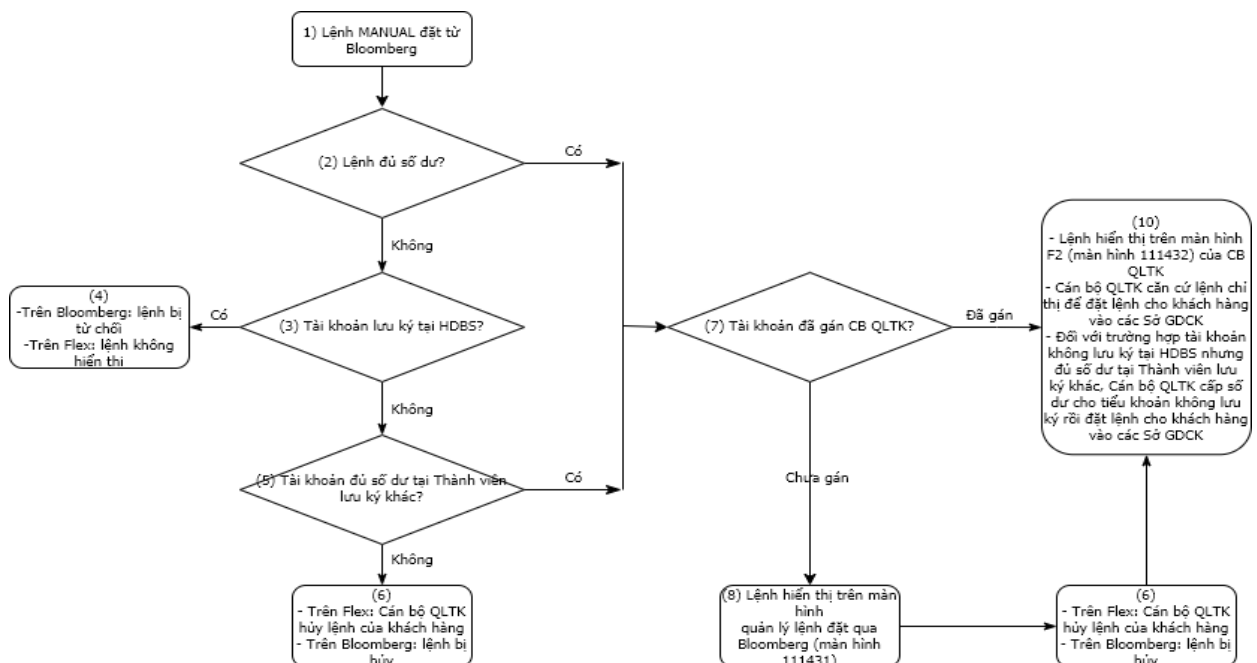
Khi lệnh AUTO được truyền đến Hệ thống Flex, lệnh được xử lý theo quy trình sau:



11. QUY TRÌNH QUẢN LÝ LỆNH ĐẶT TRÊN BLOOMBERG ĐỐI VỚI LỆNH ĐẶT GIÁN TIẾP THÔNG QUA MÔI GIỚI YÊU CẦU THỰC HIỆN CHỈ THỊ LỆNH CỤ THỂ (LỆNH MANUAL)

11.1 Lưu đồ xử lý lệnh MANUAL từ Bloomberg đến màn hình đặt lệnh môi giới trên Flex (màn hình F2) hoặc màn hình 111432 trên Flex

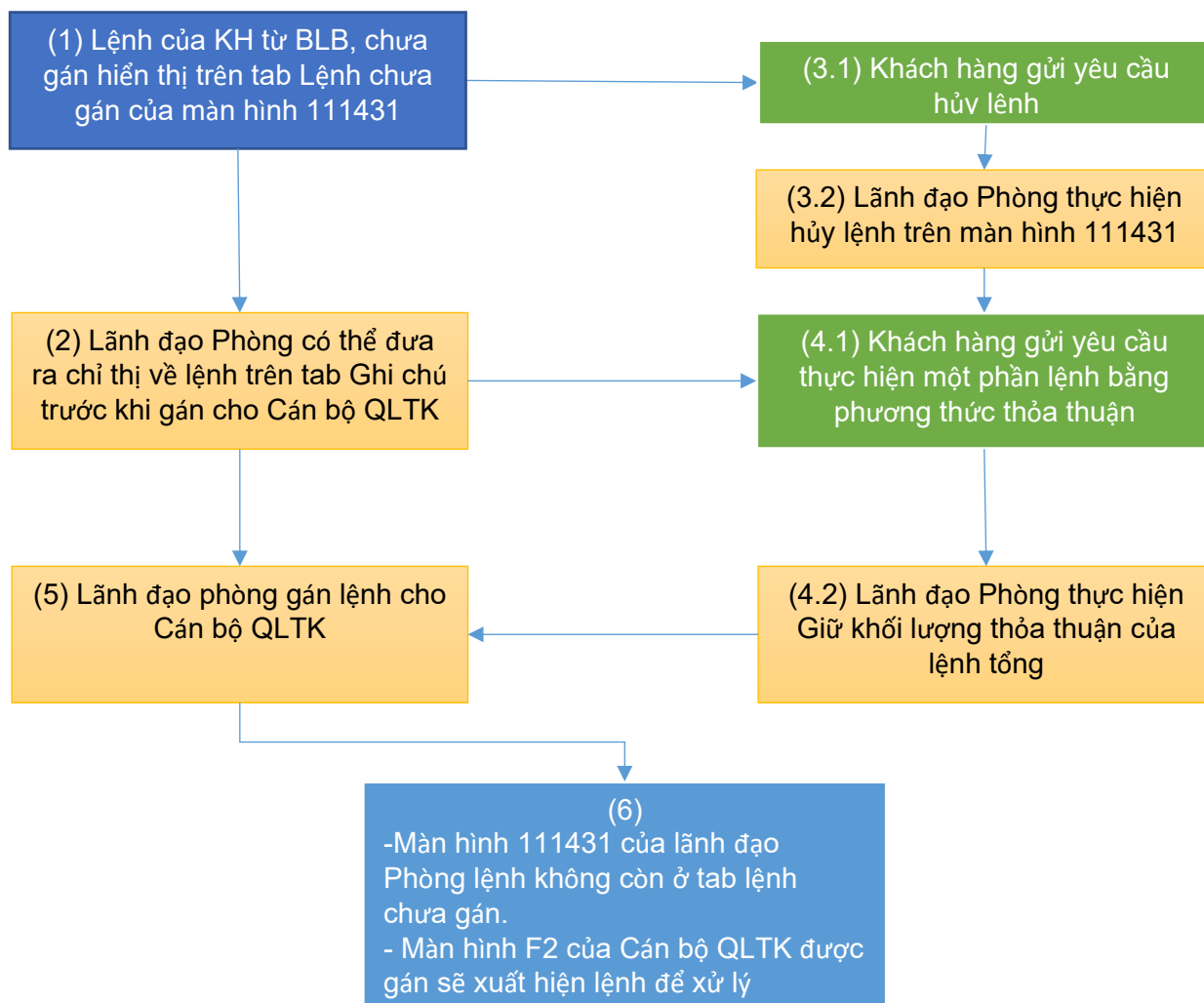
- Khi khách hàng chọn lệnh MANUAL trên BLB để đặt tới HDBS, khách hàng có thể chọn các loại lệnh:
 - Lệnh LMT: lệnh giới hạn
 - Lệnh MKT: khi đẩy vào hệ thống Flex, lệnh MKT này được hệ thống xử lý giống lệnh LMT mua với giá trần và bán với giá sàn.
- Khi đặt lệnh vào Hệ thống BLB, Hệ thống Flex kiểm tra số dư trên TKLK của KH nhưng không thực hiện phong tỏa số dư tiền/CK. Việc phong tỏa số dư tiền/CK trên TKLK của KH chỉ được thực hiện khi CBQLTK chuyển lệnh vào Hệ thống GD của các SGDCK trên cơ sở chỉ thị cụ thể lệnh đặt của KH.



Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

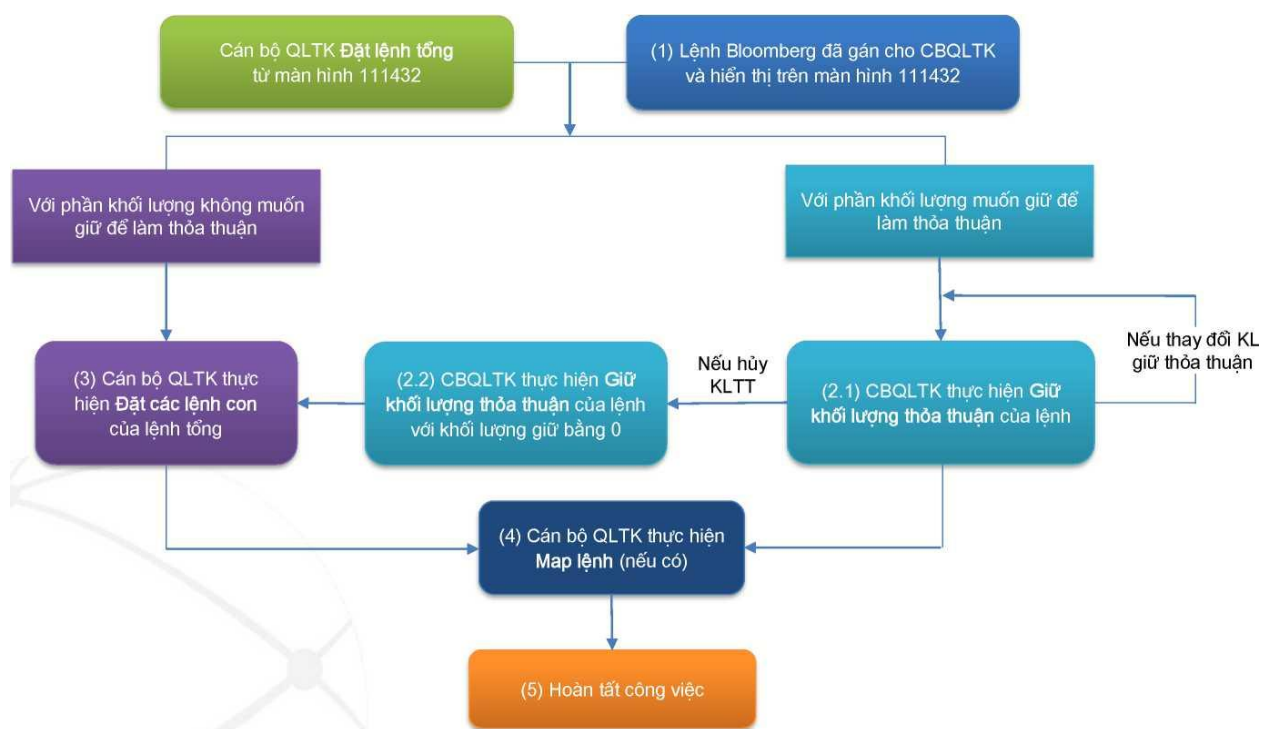
Quá trình xử lý tiếp tục đối với lệnh MANUAL được thể hiện theo 2 lưu đồ sau:

11.2 Lưu đồ xử lý lệnh chưa gán trên Màn hình quản lý lệnh đặt qua BLB (màn hình 111431)



Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

11.3 Lưu đồ xử lý lệnh đã gán cho CBQLTK trên Màn hình quản lý lệnh F2 (màn hình 111432)



11.4 Chức năng “Giữ khối lượng thỏa thuận”

Nhằm giữ lại một phần hoặc toàn bộ khối lượng của lệnh để làm giao dịch thỏa thuận

Tại thời điểm thực hiện Giữ khối lượng thỏa thuận, lệnh thỏa thuận của Khách hàng có thể đã đặt hoặc chưa đặt.

Nếu muốn thay đổi khối lượng giao dịch thỏa thuận, CBQLTK có thể thực hiện lại bước Giữ khối lượng giao dịch thỏa thuận với thông tin khối lượng giao dịch thỏa thuận giữ lại là khối lượng giao dịch thỏa thuận mới.

Nếu CBQLTK thực hiện Giữ khối lượng giao dịch thỏa thuận sai hoặc Khách hàng không muốn thực hiện lệnh thỏa thuận, CBQLTK thực hiện hủy khối lượng giữ thỏa thuận bằng việc thực hiện lại bước Giữ khối lượng thỏa thuận với thông tin khối lượng giao dịch thỏa thuận bằng 0.

13. QUY TRÌNH QUẢN LÝ LỆNH BLOOMBERG EMSX (EMSX)

Lệnh EMSX do Khách hàng đặt từ Hệ thống Bloomberg sẽ được chuyển đến CBQLTK thông qua việc hiển thị nội dung lệnh trên màn hình máy trạm Bloomberg.

Căn cứ vào lệnh đặt của Khách hàng, Cán bộ quản lý tài khoản thực hiện như sau:

1. Tiếp nhận, kiểm tra và nhập lệnh

- CBQLTK thực hiện kiểm tra lệnh giao dịch của KH đảm bảo đầy đủ và chính xác các thông tin về: mã môi giới, số Bloomberg (trader) UUID, Trader name, Customer name (tên khách hàng hoặc tên tổ chức được khách hàng ủy quyền), số tài khoản giao dịch hoặc số tiểu khoản giao dịch khớp với các thông tin đã đăng ký khai báo của Khách hàng, ngày, giờ giao dịch, khối lượng tổng (shares total), giá chỉ thị (price), mã chứng khoán (security), loại lệnh của Khách hàng, hệ thống giao dịch EMSX (system).

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

- Kiểm tra số dư tiền/CK của Khách hàng đảm bảo thực hiện lệnh

2. Xác nhận việc tiếp nhận lệnh với Khách hàng

- Đối với trường hợp lệnh đã được kiểm tra hợp lệ, nhập vào Hệ thống Flex và được hệ thống chấp nhận lệnh để đẩy vào SGDCK, CBQLTK thực hiện bấm nút ACK trên màn hình hiển thị lệnh của Bloomberg EMSX nhằm thông báo cho Khách hàng về việc đã tiếp nhận lệnh và thực hiện chuyển lệnh vào SGDCK.
- Nếu lệnh giao dịch của Khách hàng thiếu hoặc không chính xác hợp lệ một trong các thông tin yêu cầu về: số Bloomberg (trader) UUID, Trader name, Customer name, số TKGD hoặc số tiểu khoản giao dịch, ngày, giờ giao dịch, khối lượng tổng (shares total), giá chỉ thị (price), mã CK (security), loại lệnh, hệ thống giao dịch EMSX (system); lệnh bị từ chối trên hệ thống Flex hoặc lệnh của KH không đủ số dư thanh toán theo xác nhận của Thành viên lưu ký nơi Khách hàng mở tài khoản, CBQLTK từ chối lệnh và bấm nút REJ trên màn hình hiển thị lệnh của Bloomberg EMSX nhằm thông báo cho Khách hàng về việc từ chối lệnh.

3. Trao đổi thông tin với Khách hàng

- Trong quá trình nhận và chuyển Lệnh EMSX vào Hệ thống GDCK của các SGDCK, nếu phát sinh các vấn đề cần trao đổi với Khách hàng, CBQLTK phải thực hiện trao đổi thông tin qua việc chat trên Hệ thống Bloomberg đảm bảo lưu toàn bộ các thông tin đã trao đổi để phục vụ lưu trữ dữ liệu liên quan đặt lệnh giao dịch chứng khoán với Khách hàng.

4. Hủy lệnh giao

- Đối với các lệnh GD đã nhập vào Hệ thống Flex hoặc Hệ thống GD TPCP của HNX:
 - o CBQLTK phải hoàn tất việc hủy lệnh trên Hệ thống Flex hoặc Hệ thống GD TPCP sau đó mới thực hiện hủy lệnh giao dịch trên Hệ thống BLB EMSX.
 - o Sau khi hoàn tất việc hủy lệnh trên Hệ thống Flex hoặc Hệ thống giao dịch TPCP, CBQLTK thông báo ngay cho KH đã hoàn tất việc hủy lệnh thông qua chat room (Bloomberg Instant Message) trên Hệ thống BLB.
- Đối với các lệnh giao dịch chưa nhập vào Hệ thống Flex hoặc Hệ thống giao dịch TPCP của HNX: CBQLTK thực hiện hủy lệnh giao dịch trên Hệ thống Bloomberg.

5. Thông báo kết quả giao dịch tới Khách hàng

- Sau khi có kết quả giao dịch từ các SGDCK trả về, Cán bộ quản lý tài khoản thực hiện thông báo kết quả giao dịch cho Khách hàng thông qua Hệ thống Bloomberg.

6. Kết xuất dữ liệu thống kê lệnh giao dịch

- Định kỳ cuối ngày phát sinh lệnh EMSX, các Phòng KHTC, Phòng Giao dịch có trách nhiệm phân công Cán bộ nghiệp vụ kết xuất Báo cáo thống kê lệnh EMSX phát sinh trong ngày để phục vụ việc chứng minh việc Khách hàng đã đặt lệnh EMSX và lưu trữ hồ sơ.

7. Lưu trữ dữ liệu thống kê lệnh EMSX của Khách hàng

- Căn cứ dữ liệu thống kê lệnh EMSX do Hệ thống BLB trả về, Cán bộ nghiệp vụ có trách nhiệm thực hiện như sau:
 - (i) Tổng hợp lệnh giao dịch các Khách hàng phát sinh trong ngày theo mẫu Báo cáo tổng hợp lệnh giao dịch chứng khoán qua Bloomberg EMSX gửi cho Tổ kiểm soát lưu trữ hồ sơ để thực hiện lưu trữ hồ sơ theo quy định Công ty ban hành.
 - (ii) Thực hiện lưu trữ file mềm dữ liệu thống kê lệnh EMSX của Khách hàng do Hệ thống Bloomberg trả về lên ổ chung của Phòng theo tên Khách hàng và thời gian giao dịch để làm căn cứ chứng minh việc đặt lệnh giao dịch của Khách hàng.

Tài liệu hướng dẫn nhà đầu tư tham gia giao dịch công cụ nợ tại SGDCK

- *Căn cứ pháp lý: Trong trường hợp HNX ban hành các quy định mới, các văn bản thay thế đó sẽ được áp dụng.*
- *Phạm vi áp dụng: nếu có sự khác biệt giữa các văn bản, tài liệu, quy trình so với Văn bản pháp luật, sẽ áp dụng theo các Văn bản pháp luật chính thức có hiệu lực tại thời điểm đó.*