

QUYẾT ĐỊNH

V/v: Ban hành mức xử lý ký quỹ trong giao dịch Hợp đồng Kỳ hạn tiêu chuẩn hàng hóa tại Sở Giao dịch Hàng hóa Việt Nam

TỔNG GIÁM ĐỐC SỞ GIAO DỊCH HÀNG HÓA VIỆT NAM

- Căn cứ Luật Thương mại số 36/2005/QH11 ngày 14/6/2005;
- Căn cứ Nghị định số 158/2006/NĐ-CP ngày 28/12/2006 của Chính phủ quy định chi tiết Luật Thương mại về hoạt động mua bán hàng hóa qua Sở Giao dịch hàng hóa;
- Căn cứ Nghị định số 51/2018/NĐ-CP ngày 9/4/2018 của Chính phủ ban hành sửa đổi, bổ sung một số điều của Nghị định 158/2006/NĐ-CP ngày 28/12/2006 của Chính phủ quy định chi tiết Luật Thương mại về hoạt động mua bán hàng hóa qua Sở Giao dịch hàng hóa;
- Căn cứ Quyết định số 1369/QĐ-BCT của Bộ trưởng Bộ Công Thương ngày 22/05/2020 về việc bổ sung một số mặt hàng thuộc nhóm kinh doanh có điều kiện niêm yết giao dịch trên Sở Giao dịch hàng hóa;
- Căn cứ Điều lệ tổ chức hoạt động của Sở Giao dịch Hàng hóa Việt Nam;
- Căn cứ Quy chế niêm yết và giao dịch Hợp đồng kỳ hạn tiêu chuẩn hàng hóa tại Sở Giao dịch hàng hóa Việt Nam.
- Căn cứ Quy chế Hoạt động và Quản lý rủi ro của Trung tâm thanh toán bù trừ;
- Theo đề nghị của Giám đốc Khối Quản lý rủi ro.

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Mức xử lý ký quỹ đối với những tài khoản giao dịch Hợp đồng Kỳ hạn tiêu chuẩn hàng hóa không bao gồm các mặt hàng năng lượng thuộc Sở Giao dịch Hàng hóa Việt Nam (MXV) như sau:

1. Mức ký quỹ duy trì của tài khoản giao dịch = **100%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này, tài khoản giao dịch phải thực hiện bổ sung ký quỹ về mức ký quỹ ban đầu yêu cầu.
2. Mức hủy các lệnh chờ khớp của tài khoản giao dịch = **70%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này MXV sẽ hủy toàn bộ lệnh đang chờ khớp của tài khoản giao dịch đang có trên sổ lệnh của hệ thống.
3. Mức tắt toán vị thế bắt buộc của tài khoản giao dịch = **40%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này MXV sẽ tắt toán toàn bộ vị thế mở của tài khoản giao dịch để đảm bảo an toàn ký quỹ.
4. Thành viên kinh doanh có thể đề xuất điều chỉnh các mức ký quỹ đối với từng tài khoản giao dịch nhưng không được thấp hơn các mức ký quỹ đã quy định tại Điều này.

Điều 2. Mức xử lý ký quỹ đối với những tài khoản giao dịch Hợp đồng kỳ hạn tiêu chuẩn hàng hóa có bao gồm các mặt hàng thuộc nhóm năng lượng tại MXV như sau:

1. Mức ký quỹ duy trì của tài khoản giao dịch = **100%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này, tài khoản giao dịch phải thực hiện bổ sung ký quỹ về mức ký quỹ ban đầu yêu cầu.

2. Mức hủy các lệnh chờ khớp của tài khoản giao dịch = **80%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này MXV sẽ hủy toàn bộ lệnh đang chờ khớp của tài khoản giao dịch đang có trên sổ lệnh của hệ thống.
3. Mức tất toán vị thế bắt buộc của tài khoản giao dịch = **60%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
Vi phạm mức ký quỹ này MXV sẽ tất toán toàn bộ vị thế mở của tài khoản giao dịch để đảm bảo an toàn ký quỹ.
4. Thành viên kinh doanh có thể đề xuất điều chỉnh các mức ký quỹ đối với từng tài khoản giao dịch nhưng không được thấp hơn các mức ký quỹ đã quy định tại Điều này.

Điều 3. Quy định mức ký quỹ của Thành viên kinh doanh

- Mức ký quỹ bắt buộc của Thành viên kinh doanh = **100%** tổng mức ký quỹ ban đầu.
- Thành viên kinh doanh phải có nghĩa vụ duy trì mức ký quỹ này khi cho khách hàng tham gia giao dịch.
- Bất kỳ khi nào tỷ lệ ký quỹ của Thành viên kinh doanh xuống dưới mức 120% MXV sẽ gửi thông báo cảnh báo nhắc nhở.
- Nếu tỷ lệ ký quỹ của Thành viên kinh doanh xuống dưới 100% bộ phận nghiệp vụ của MXV sẽ gửi thông báo đến Thành viên kinh doanh. Đồng thời MXV sẽ tạm thời dừng nghiệp vụ rút tiền ký quỹ của Thành viên kinh doanh đến khi thành viên kinh doanh thực hiện nghĩa vụ duy trì mức ký quỹ bắt buộc.
- Sau 24 giờ kể từ khi nhận thông báo, nếu Thành viên kinh doanh vẫn chưa đưa ký quỹ về mức ký quỹ bắt buộc MXV sẽ tất toán toàn bộ trạng thái của các tài khoản giao dịch vi phạm mức ký quỹ 100% của Thành viên kinh doanh.

Điều 4. Quyết định này có hiệu lực kể từ ngày ký.

Điều 5. Ban Giám đốc, Giám đốc các Khối, Ban, Đơn vị nghiệp vụ trực thuộc Sở Giao dịch hàng hóa Việt Nam; các Thành viên; các tổ chức và cá nhân liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này./.

Nơi nhận:

- Như Điều 5;
- HĐQT, BKS (để b/c);
- Lưu HC./.

KT. TỔNG GIÁM ĐỐC



PHÓ TỔNG GIÁM ĐỐC

Dương Đức Quang