

## Hướng dẫn giao dịch công cụ nợ

### 1. Thời gian giao dịch

Các phiên giao dịch được thực hiện từ thứ 2 đến thứ 6 hàng tuần trừ ngày lễ, Tết, và các ngày nghỉ khác theo quy định của Luật Lao động, UBCKNN, Sở GDCK Hà Nội, Tổng công ty lưu ký và bù trừ chứng khoán Việt Nam.

| Phương thức giao dịch  | Giờ giao dịch            |
|------------------------|--------------------------|
| Giao dịch trong ngày   |                          |
| Khớp lệnh thỏa thuận   | 9h00' đến 11h30'         |
| <b>Nghỉ giữa phiên</b> | <b>11h30' đến 13h00'</b> |
| Khớp lệnh thỏa thuận   | 13h00' đến 14h45'        |
| Giao dịch tương lai    |                          |
| Khớp lệnh thỏa thuận   | 9h00' đến 11h30'         |
| <b>Nghỉ giữa phiên</b> | <b>11h30' đến 13h00'</b> |
| Khớp lệnh thỏa thuận   | 13h00' đến 17h00'        |

### 2. Công cụ nợ

Loại công cụ nợ bao gồm:

- Công cụ nợ của Chính phủ (trái phiếu Chính phủ, tín phiếu Kho Bạc, công trái xây dựng Tổ quốc)
- Trái phiếu được chính phủ bảo lãnh
- Trái phiếu chính quyền địa phương

### 3. Mệnh giá niêm yết và đơn vị giao dịch

- Mệnh giá của công cụ nợ niêm yết trên SGDCK là một trăm nghìn (100.000) đồng hoặc bội số của một trăm nghìn (100.000) đồng.
- Đơn vị giao dịch quy định là một (01) công cụ nợ.

### 4. Đơn vị yết giá

- Đơn vị của giá yết quy định là một (01) đồng.
- Đơn vị của giá thực hiện do hệ thống tính được làm tròn đến đồng.

## 5. Khối lượng giao dịch tối thiểu

- Khối lượng giao dịch công cụ nợ tối thiểu áp dụng cho hình thức thỏa thuận điện tử và hình thức thỏa thuận thông thường là một trăm (100) công cụ nợ.
- Đối với giao dịch mua bán lại gồm nhiều mã công cụ nợ, khối lượng giao dịch tối thiểu của mỗi mã công cụ nợ là một trăm (100) công cụ nợ.
- Đối với giao dịch mua bán thông thường có khối lượng từ một (01) đến chín chín (99) công cụ nợ (giao dịch lẻ) được thực hiện trực tiếp giữa nhà đầu tư và thành viên giao dịch thông thường hoặc giữa các thành viên giao dịch công cụ nợ với nhau theo nguyên tắc thỏa thuận về giá.

## 6. Hình thức giao dịch

Sở giao dịch Chứng khoán Hà Nội tổ chức 4 loại hình giao dịch, bao gồm:

- Giao dịch mua bán thông thường là giao dịch trên hệ thống giao dịch trong đó một bên bán và chuyển giao quyền sở hữu công cụ nợ cho một bên khác và không kèm theo cam kết mua lại công cụ nợ.
- Giao dịch mua bán lại là giao dịch trên hệ thống giao dịch trong đó một bên bán và chuyển giao quyền sở hữu công cụ nợ cho một bên khác, đồng thời cam kết sẽ mua lại và nhận lại quyền sở hữu công cụ nợ đó sau một thời gian xác định với một mức giá xác định. Giao dịch mua bán lại bao gồm giao dịch bán (Giao dịch lần 1) và giao dịch mua lại (Giao dịch lần 2). Trong giao dịch mua bán lại, bên bán được hiểu là bên bán trong Giao dịch lần 1, bên mua được hiểu là bên mua trong Giao dịch lần 1.
- Giao dịch bán kết hợp mua lại (SBB) là giao dịch trên hệ thống giao dịch kết hợp hai giao dịch mua bán thông thường tại cùng một thời điểm với cùng một đối tác giao dịch, bao gồm một giao dịch bán công cụ nợ (Giao dịch thông thường lần 1) kết hợp với một giao dịch mua lại cùng công cụ nợ đó (Giao dịch thông thường lần 2) tại một thời điểm xác định trong tương lai. Trong đó, bên bán trong giao dịch

thông thường lần 1 là bên mua trong giao dịch thông thường lần 2; đồng thời giá, khối lượng, thời điểm thực hiện của giao dịch thông thường lần 2 phải được xác định trước tại thời điểm giao kết hai giao dịch.

- Giao dịch vay và cho vay (SBL) là giao dịch trong đó bên đi vay thực hiện vay công cụ nợ và cam kết sẽ hoàn trả công cụ nợ đã vay cho bên cho vay sau một thời gian xác định. Giao dịch vay và cho vay được thực hiện theo thỏa thuận giữa các bên và trên hệ thống giao dịch tại Sở Giao dịch Chứng khoán hoặc trên hệ thống vay, cho vay chứng khoán tại Tổng công ty lưu ký và bù trừ chứng khoán Việt Nam. Các bên liên quan tự thỏa thuận và chịu trách nhiệm về các nội dung liên quan đến khối lượng vay, tài sản vay và hoàn trả, tài sản đảm bảo, lãi suất vay và các điều khoản khác, đảm bảo các thỏa thuận này tuân thủ đầy đủ các quy định pháp luật áp dụng cho các bên tham gia giao dịch và quy chế của Sở Giao dịch Chứng khoán, Tổng công ty lưu ký và bù trừ chứng khoán Việt Nam

## **7. Phương thức giao dịch**

### **a) Phương thức thỏa thuận điện tử**

Phương thức thỏa thuận điện tử bao gồm các loại lệnh sau đây:

- Lệnh thỏa thuận điện tử toàn thị trường:
  - Lệnh thỏa thuận điện tử toàn thị trường là các lệnh chào mua, chào bán với cam kết chắc chắn có hiệu lực trong ngày được chào công khai trên hệ thống.
  - Lệnh thỏa thuận điện tử toàn thị trường chỉ áp dụng đối với giao dịch mua bán thông thường.
- Lệnh thỏa thuận điện tử tùy chọn: Bao gồm hai loại lệnh sau:
  - Lệnh yêu cầu chào giá: Lệnh yêu cầu chào giá có tính chất quảng cáo được sử dụng khi nhà đầu tư chưa xác định được đối tác trong giao dịch. Lệnh yêu cầu chào giá có thể gửi đến một, một nhóm thành viên hoặc toàn thị

trường. Trường hợp khách hàng không yêu cầu cụ thể thì lệnh yêu cầu chào giá được gửi cho toàn bộ thị trường.

- Lệnh chào mua, chào bán với cam kết chắc chắn: Lệnh chào với cam kết chắc chắn được sử dụng để chào đối ứng với lệnh yêu cầu chào giá. Lệnh chào với cam kết chắc chắn chỉ được gửi đích danh cho thành viên gửi Lệnh yêu cầu chào giá.

#### **b) Phương thức thỏa thuận thông thường**

- Phương thức thỏa thuận thông thường bao gồm lệnh báo cáo giao dịch. Lệnh báo cáo được sử dụng để nhập giao dịch vào hệ thống trong trường hợp giao dịch đã được các bên thỏa thuận xong về các điều kiện trong giao dịch.
- Kết quả giao dịch phải được báo cáo và nhập vào hệ thống giao dịch trong thời hạn 01 ngày làm việc kể từ ngày các bên thỏa thuận xong về giao dịch. Thông tin báo cáo vào hệ thống bao gồm: thời điểm giao kết giao dịch, thời điểm ký hợp đồng, thời điểm thực hiện giao dịch (thời điểm chuyển giao công cụ nợ và thanh toán giao dịch) và các thông tin khác có liên quan.
- Thời gian kể từ ngày nhập kết quả giao dịch mua bán thông thường vào hệ thống đến ngày thực hiện giao dịch không được vượt quá ba (03) ngày làm việc.

### **8. Hủy/sửa lệnh thỏa thuận**

#### **a) Lệnh thỏa thuận sửa/hủy không qua SGDCK:**

Khách hàng có thể yêu cầu AIS thực hiện sửa/hủy lệnh mà không cần đợi SGDCK phê duyệt trong những trường hợp sau:

- Lệnh thỏa thuận nhập từ EBTS, nhưng chưa gửi vào BTS;
  - Lệnh thỏa thuận ở trạng thái chưa thực hiện;
  - Lệnh thỏa thuận tương lai chưa đến hạn giao dịch hoặc chưa xác nhận:
- Được sự đồng thuận của các bên đối tác tham gia giao dịch;

- Nội dung sửa lệnh: ngoại trừ thông tin Mua/bán, thông tin thị trường và thông tin thành viên đối tác, thành viên/NĐT có thể sửa tất cả thông tin còn lại đã thỏa thuận trên lệnh.

**b) Đối với lệnh trong ngày có trạng thái đã được thực hiện việc sửa, hủy lệnh**

**chỉ được phép khi:**

- Được sự đồng thuận của các bên đối tác tham gia giao dịch;
- Có lý do sửa hợp lý;
- SGDCKHN chấp thuận.
- Nội dung sửa lệnh: ngoại trừ thông tin Mua/bán, thông tin thị trường và thông tin thành viên đối tác, thành viên/NĐT có thể sửa tất cả thông tin còn lại đã thỏa thuận trên lệnh.

**c) Đối với loại hình giao dịch mua bán lại, bán kết hợp mua lại, vay và cho vay**

đã thực hiện giao dịch và chưa đến hạn thanh toán giao dịch lần 2, có thể sửa giao dịch lần 2 khi:

- Được sự đồng thuận của các bên đối tác tham gia giao dịch;
- Có lý do sửa hợp lý;
- SGDCKHN chấp thuận.
- Nội dung sửa lệnh: Lãi suất Repos; kỳ hạn Repos; lãi suất trên lãi coupon (nếu có); trái phiếu tương đương

**9. Thời gian thanh toán**

**a) Ngày giao dịch** là ngày công cụ nợ được giao dịch trên hệ thống giao dịch công cụ nợ của SGDCK.

**b) Ngày thanh toán công cụ nợ** là ngày bên mua hoặc bên bán công cụ nợ nhận được công cụ nợ hoặc tiền..

**c) Thời hạn toán giao dịch công cụ nợ:** T+1 là ngày làm việc liền kề sau ngày giao dịch.

- Đối với lệnh mua bán thông thường; có 1 ngày thanh toán là T+1 của ngày

giao dịch công cụ nợ trên hệ thống giao dịch của SGDCK.

- Đối với lệnh mua bán lại (Repos), Bán kết hợp mua lại (SBB), Cho vay (SBL)

thì có 2 ngày thanh toán:

- Ngày thanh toán lần 1 là ngày T+1 của ngày giao dịch lần 1 trên hệ thống giao dịch công cụ nợ của SGDCK.

- Ngày thanh toán lần 2 là ngày T+1 của ngày giao dịch lần 2 trên hệ thống giao dịch công cụ nợ của SGDCK