

CÔNG TY CỔ PHẦN CHỨNG KHOÁN KỸ THUẬT



CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

---***---

Số: 051005/21/TT-TCBS

Hà Nội, ngày 10 tháng 05 năm 2021

TỜ TRÌNH

(V/v: Điều chỉnh danh mục cho vay giao dịch ký quỹ)

Kính gửi: - **Hội đồng phê duyệt hoạt động giao dịch ký quỹ**

Kính trình Hội đồng phê duyệt hoạt động GDKQ, phê duyệt điều chỉnh danh mục margin cho vay giao dịch ký quỹ (GDKQ), chi tiết như sau:

1. Căn cứ:

- Quyết định số 87/QĐ-UBCK ngày 25/01/2017 về việc ban hành quy chế hướng dẫn GDKQ chứng khoán;
- Quy chế phân cấp thẩm quyền phê duyệt nghiệp vụ cho vay GDKQ năm 2019 ban hành theo Nghị quyết số 1485/2019/NQ-HĐQT-TCBS ngày 11/11/2019;
- Hướng dẫn quản trị rủi ro đối với margin lending của TCBS năm 2020;
- Danh sách các mã chứng khoán được phép GDKQ theo công bố trên website của 2 Sở giao dịch chứng khoán tính đến ngày 10/05/2021;
- Diễn biến thực tế giao dịch trên thị trường và tại TCBS;
- Ý kiến tham vấn của bộ phận Phân tích.

2. Đề xuất:

- Điều chỉnh danh mục các mã chứng khoán cho vay GDKQ, hạn mức room, giá chặn cho vay, giá chặn tính tài sản, tỷ lệ cho vay, tỷ lệ tính tài sản trên hệ thống Flex (chi tiết theo các Phụ lục).
- Phân quyền cho Phó Tổng giám đốc phụ trách iWealth phê duyệt các vấn đề chi tiết liên quan đến thiết lập tham số hệ thống Flex đảm bảo hỗ trợ cho các khách hàng có thời gian xử lý tài sản và không vượt các hạn mức theo chính sách về danh mục mã, room, giá chặn và tỷ lệ đã được phê duyệt.
- Hiệu lực: **11/05/2021**

Trân trọng kính trình!



NGHIÊN CỨU VÀ PHÂN TÍCH

BỘ PHẬN IWEALTH

QUẢN TRỊ RỦI RO

DocuSigned by:
Nguyễn Mạnh Việt
82F4C8E1DBDD416...
Nguyễn Mạnh Việt

DocuSigned by:
Long B. Mai Hoàng
815A9EB56D394B4...
Mai Hoàng Long

DocuSigned by:
Vũ Long
0114EB3ECD3747A...
Vũ Long

Ý KIẾN CỦA HỘI ĐỒNG PHÊ DUYỆT

P.TGD PHỤ TRÁCH IWEALTH DocuSigned by: <i>[Signature]</i> 1BFB501319894D7... Nhâm Hà Hải	<input checked="" type="checkbox"/> Đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không có ý kiến

TỔNG GIÁM ĐỐC DocuSigned by: <i>[Signature]</i> 87958871E0F6471... Nguyễn Thị Thu Hiền	<input checked="" type="checkbox"/> Đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không có ý kiến

THÀNH VIÊN HĐQT PHỤ TRÁCH QUẢN TRỊ RỦI RO Lê Huy Hoàng	<input type="checkbox"/> Đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không có ý kiến

CHỦ TỊCH HĐQT DocuSigned by: <i>[Signature]</i> B0FEFE5A83A3487... Nguyễn Xuân Minh	<input checked="" type="checkbox"/> Đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không đồng ý
	<input type="checkbox"/> Không có ý kiến



PHỤ LỤC 01 – DANH MỤC CHO VAY MARGIN MỚI ĐỀ XUẤT

(Áp dụng từ ngày 11 / 05 / 2021)

- Danh mục các mã CK được điều chỉnh so với danh mục hiện tại:

STT	Mã CK	Hiện tại			Đề xuất			Dư nợ tối đa dự kiến	Ghi chú
		Giá chặn	Tỷ lệ	Room	Giá chặn	Tỷ lệ	Room		
1	ACB	36,900	50%	25,390,243	36,900	50%	24,390,244	450,000,001,800	
2	AGG	31,000	50%	3,723,700	35,000	50%	3,298,134	57,717,345,000	
3	CII	27,400	50%	11,203,575	22,000	50%	9,000,000	99,000,000,000	
4	CMG	43,000	50%	279,070	37,500	50%	320,000	6,000,000,000	
5	CMX	18,300	50%	546,448	15,000	50%	666,667	5,000,002,500	
6	CNG	28,300	50%	170,123	23,700	50%	203,143	2,407,244,550	
7	CSV	36,400	50%	274,725	29,700	50%	336,700	4,999,995,000	
8	CTD	85,700	50%	1,166,861	68,400	50%	1,461,988	49,999,989,600	
9	DXP	18,000	50%	1,081,125	13,000	50%	1,496,943	9,730,129,500	
10	EIB	26,000	50%	1,230,769	29,000	50%	1,103,448	15,999,996,000	
11	FCN	13,500	50%	740,741	11,000	50%	909,091	5,000,000,500	
12	FMC	33,000	50%	606,061	28,000	50%	714,286	10,000,004,000	
13	GVR	28,000	50%	5,357,143	20,000	50%	7,500,000	75,000,000,000	
14	HAH	28,800	50%	347,222	28,900	50%	346,021	5,000,003,450	
15	HPG	50,900	50%	17,687,766	65,800	50%	13,677,812	450,000,014,800	
16	ICT	26,500	50%	191,382	20,800	50%	243,827	2,535,800,800	
17	ILB	24,000	50%	425,618	24,000	50%	425,617	5,107,404,000	
18	KSB	30,000	50%	666,667	22,000	50%	909,091	10,000,001,000	
19	LCG	12,000	50%	833,333	10,000	50%	1,000,000	5,000,000,000	
20	MSN	88,000	50%	12,591,837	100,000	50%	11,080,817	554,040,850,000	
21	NRC	22,000	50%	181,818	13,000	50%	307,692	1,999,998,000	
22	NVL	106,300	50%	6,174,976	130,000	50%	5,046,154	328,000,010,000	
23	PDR	50,000	50%	800,000	55,000	50%	727,273	20,000,007,500	
24	PHR	67,700	50%	2,895,126	56,100	50%	3,493,761	97,999,996,050	
25	PNJ	92,000	50%	2,152,174	104,700	50%	1,891,117	98,999,974,950	
26	PVD	26,600	50%	3,759,398	20,400	50%	4,901,961	50,000,002,200	
27	SBT	25,000	50%	12,920,000	25,000	50%	15,939,473	199,243,412,500	
28	SFG	11,200	50%	86,920	9,500	50%	102,474	486,751,500	
29	SHB	18,000	50%	45,036,496	18,000	50%	46,920,152	422,281,368,000	
30	SHI	11,000	50%	909,091	15,000	50%	666,667	5,000,002,500	
31	SZL	60,000	50%	131,646	60,000	50%	89,668	2,690,040,000	
32	TDC	19,000	50%	526,316	15,000	50%	666,667	5,000,002,500	
33	TIG	8,000	50%	1,250,000	10,000	50%	1,000,000	5,000,000,000	
34	VHC	46,600	50%	3,862,661	39,700	50%	4,534,005	89,999,999,250	
35	VHM	109,200	50%	5,983,516	109,200	50%	6,227,106	339,999,987,600	
36	VIC	115,200	50%	7,431,250	135,000	50%	8,222,222	554,999,985,000	
37	VIP	9,000	50%	668,527	8,000	50%	752,093	3,008,372,000	
38	VIT	19,500	50%	102,564	21,000	50%	95,238	999,999,000	
39	VJC	130,000	50%	8,538,462	125,000	50%	8,538,462	533,653,875,000	
40	VPB	45,500	50%	21,094,017	55,000	50%	20,181,818	554,999,995,000	
41	VRE	38,300	50%	17,060,052	38,300	50%	17,859,008	342,000,003,200	



42	BCM				61,600	50%	201,743	6,213,684,400	Mã mới
43	VSH				22,000	50%	500,262	5,502,882,000	Mã mới
44	CHP				16,000	50%	177,672	1,421,376,000	Mã mới
45	TLH				10,000	50%	8,270,960	41,354,800,000	Mã mới
46	PLX				54,600	50%	3,626,374	99,000,010,200	Mã mới
47	TRA				75,900	50%	92,493	3,510,109,350	Mã mới
48	AST				60,500	50%	165,289	4,999,992,250	Mã mới
49	MSH				58,500	50%	290,753	8,504,525,250	Mã mới
50	RAL				251,900	50%	167,378	21,081,259,100	Mã mới
51	LAS				7,000	50%	3,851,465	13,480,127,500	Mã mới
52	CLC				31,000	50%	177,556	2,752,118,000	Mã mới
53	VDS				10,000	50%	4,746,594	23,732,970,000	Mã mới
54	SCI				50,000	50%	980,097	24,502,425,000	Mã mới
55	PGS				16,000	50%	247,544	1,980,352,000	Mã mới
56	EVE				10,000	50%	613,150	3,065,750,000	Mã mới
57	GSP				11,000	50%	344,662	1,895,641,000	Mã mới
58	DC4				11,000	50%	93,769	515,729,500	Mã mới
59	SFI				30,000	50%	91,487	1,372,305,000	Mã mới
60	DAG				5,500	50%	4,195,402	11,537,355,500	Mã mới
61	HTI				14,000	50%	684,061	4,788,427,000	Mã mới

- Các mã CK bị loại khỏi danh mục cho vay hiện tại:

STT	Mã CK	Lý do loại khỏi danh mục
1	ACL	Các công ty lớn không cho vay.
2	AGM	Các công ty lớn không cho vay.
3	ASP	Các công ty lớn không cho vay.
4	BAX	Các công ty lớn không cho vay.
5	EVG	Các công ty lớn không cho vay.
6	HHP	Các công ty lớn không cho vay.
7	HOM	Các công ty lớn không cho vay.
8	HUB	Các công ty lớn không cho vay.
9	LIG	Các công ty lớn không cho vay.
10	PLP	Các công ty lớn không cho vay.
11	SAV	Các công ty lớn không cho vay.
12	SBV	Các công ty lớn không cho vay.
13	SGR	Các công ty lớn không cho vay.
14	SRA	Các công ty lớn không cho vay.
15	TVD	Các công ty lớn không cho vay.
16	TVS	Các công ty lớn không cho vay.
17	VMC	Các công ty lớn không cho vay.
18	VPD	KLGD trung bình 20 phiên < 10.000 cp

- Các mã CK khác trong danh mục hiện tại giữ nguyên không thay đổi.

