

Quy định Giao dịch chứng quyền có bảo đảm (CW) tại Sở giao dịch chứng khoán Hồ Chí Minh (HSX)

Thời gian giao dịch	Khớp lệnh định kỳ mở cửa	08:45 – 09:00
	Khớp lệnh liên tục phiên sáng	09:00 – 11:30
	Khớp lệnh liên tục phiên chiều	13:00 – 14:30
	Khớp lệnh định kỳ đóng cửa	14:30 – 14:45
	Thỏa thuận	08:45 – 14:45
Loại lệnh áp dụng	ATO, LO, MP, ATC	
Chứng khoán cơ sở	Cổ phiếu	
Tổ chức phát hành	Công ty Chứng khoán	
Loại chứng quyền	Chứng quyền mua	
Đơn vị giao dịch	10 CW	
Bước giá CW	10 đồng cho tất cả các mức giá	
Cách xác định giá trần/sàn	<p>Giá trần/sàn trong ngày giao dịch đầu tiên và ngày giao dịch thông thường của chứng quyền mua dựa trên chứng khoán cơ sở là cổ phiếu được xác định như sau:</p> <ul style="list-style-type: none">- Giá trần = Giá tham chiếu chứng quyền + (giá trần của cổ phiếu cơ sở - Giá tham chiếu của cổ phiếu cơ sở) x 1/Tỷ lệ chuyển đổi- Giá sàn = Giá tham chiếu chứng quyền - (giá tham chiếu của cổ phiếu cơ sở - Giá sàn của cổ phiếu cơ sở) x 1/Tỷ lệ chuyển đổi- Trường hợp giá sàn của chứng quyền nhỏ hơn hoặc bằng không (0), giá sàn sẽ là đơn vị yết giá nhỏ nhất bằng 10 đồng.	
Cách xác định giá tham chiếu ngày giao dịch đầu tiên	<p>Đối với chứng quyền mua dựa trên chứng khoán cơ sở là cổ phiếu, giá tham chiếu trong ngày giao dịch đầu tiên được xác định như sau:</p> <ul style="list-style-type: none">- Giá tham chiếu của chứng quyền mua = Giá phát hành của chứng quyền x (Giá tham chiếu của cổ phiếu cơ sở vào ngày giao dịch đầu tiên của chứng quyền/Giá tham chiếu của cổ phiếu cơ sở tại ngày thông báo phát hành chứng quyền) x (Tỷ lệ chuyển đổi tại ngày thông báo phát hành chứng quyền/Tỷ lệ chuyển đổi tại ngày giao dịch đầu tiên)	

Phương thức giao dịch	Khớp lệnh và thỏa thuận (Không được giao dịch thỏa thuận trong ngày giao dịch đầu tiên)
Hủy lệnh	<ul style="list-style-type: none"> - Chỉ có hiệu lực với lệnh chưa thực hiện hoặc phần còn lại của lệnh chưa thực hiện. - Không được hủy lệnh trong phiên khớp lệnh định kỳ
Ngày giao dịch cuối cùng	Là ngày giao dịch trước hai (02) ngày so với ngày đáo hạn của chứng quyền có bảo đảm. Các trường hợp chứng quyền bị hủy niêm yết (không bao gồm chứng quyền đáo hạn), ngày giao dịch cuối cùng của chứng quyền là ngày giao dịch liền trước ngày hủy niêm yết chứng quyền có hiệu lực.
Ngày đáo hạn	Là ngày cuối cùng mà người sở hữu chứng quyền được thực hiện chứng quyền
Giá thanh toán	Là mức giá được Sở GDCK TP.HCM tính toán và công bố vào ngày đáo hạn của chứng quyền. Đối với chứng quyền dựa trên chứng khoán cơ sở là cổ phiếu và thực hiện theo kiểu Châu Âu, giá thanh toán chứng quyền khi thực hiện quyền là bình quân giá đóng cửa của chứng khoán cơ sở trong năm (05) ngày giao dịch liền trước ngày đáo hạn, không bao gồm ngày đáo hạn
Phương thức thanh toán	Thanh toán bằng tiền. Theo đó, người sở hữu chứng quyền sẽ nhận được khoảng tiền chênh lệch khi giá thanh toán của chứng khoán cơ sở cao hơn giá thực hiện.
Một số quy định khác	<ul style="list-style-type: none"> - Công ty chứng khoán không được cho nhà đầu tư thực hiện giao dịch ký quỹ đối với chứng quyền - TCPH Chứng khoán cơ sở không được đầu tư, giao dịch chứng quyền dựa trên chứng khoán của tổ chức đó - Nhà đầu tư nước ngoài không bị hạn chế tỷ lệ sở hữu chứng quyền - Quỹ đại chúng chỉ được đầu tư vào chứng quyền nhằm mục tiêu phòng ngừa rủi ro

Quy chế giao dịch chứng khoán tại HSX năm 2018 xem [tại đây](#)

Thông tư Hướng dẫn chào bán và giao dịch chứng quyền có bảo đảm số 107/2016/TT-BTC năm 2016 xem [tại đây](#)