

Số: **76** /QĐ-HĐTV

Hà Nội, ngày **28** tháng **8** năm 2026

QUYẾT ĐỊNH

**Về việc ban hành Quy chế giám sát tăng cường đối với giao dịch
chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell**

HỘI ĐỒNG THÀNH VIÊN

SỞ GIAO DỊCH CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM

Căn cứ Luật Chứng khoán số 54/2019/QH14 ngày 26/11/2019 được sửa đổi bổ sung bởi Luật số 56/2024/QH15 ngày 29/11/2024;

Căn cứ Quyết định số 37/2020/QĐ-TTg ngày 23/12/2020 của Thủ tướng Chính phủ về việc thành lập, tổ chức và hoạt động của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam;

Căn cứ Thông tư số 95/2020/TT-BTC ngày 16/11/2020 của Bộ trưởng Bộ Tài chính hướng dẫn giám sát giao dịch chứng khoán trên thị trường chứng khoán được sửa đổi bổ sung bởi Thông tư số 138/2025/TT-BTC ngày 30/12/2025;

Căn cứ Công văn số 8558/UBCK-GS ngày 28/8/2026 của Ủy ban Chứng khoán Nhà nước về việc chấp thuận Quy chế giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell;

Căn cứ Nghị quyết số 39/NQ-HĐTV ngày 28/8/2026 của Hội đồng thành viên về việc phê duyệt nội dung dự thảo Quy chế giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell;

Theo đề nghị của Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam.

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này Quy chế giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell.

Điều 2. Quyết định này có hiệu lực kể từ ngày ký.

Điều 3. Tổng Giám đốc Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam, Thủ trưởng các đơn vị thuộc Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam, Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh và các tổ chức, cá nhân có liên quan chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. /.

Nơi nhận:

- Như Điều 3;
- UBCKNN (để b/c);
- HĐTV, BKS;
- Lưu: VT, GSTT (b).



Lương Hải Sinh

**QUY CHẾ GIÁM SÁT TĂNG CƯỜNG ĐỐI VỚI GIAO DỊCH
CHỨNG KHOÁN TRONG CÁC KỲ CƠ CẤU CHỈ SỐ FTSE RUSSELL**
(Ban hành kèm theo Quyết định số 76./QĐ-HĐTV ngày 28 tháng 8 năm 2026
của Hội đồng thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam)

Điều 1. Phạm vi và mục đích

1. Quy chế này quy định về hoạt động giám sát tăng cường đối với các cổ phiếu niêm yết tại Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh trong thời kỳ cơ cấu danh mục chỉ số do FTSE Russell xây dựng, quản lý theo thỏa thuận hợp tác với Sở Giao dịch chứng khoán Việt Nam và công ty con.

2. Hoạt động giám sát tăng cường nhằm nhận diện sớm các giao dịch có dấu hiệu thao túng giá chứng khoán hoặc sử dụng thông tin nội bộ để trục lợi trong thời kỳ cơ cấu danh mục chỉ số.

Điều 2. Đối tượng áp dụng

1. Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam (VNX).
2. Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh (HOSE).
3. Thành viên giao dịch của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam.

Điều 3. Giải thích từ ngữ

Trong Quy chế này, các từ ngữ dưới đây được hiểu như sau:

1. *Chỉ số FTSE Russell*: là các chỉ số do FTSE Russell xây dựng, quản lý và tính toán, có sử dụng cổ phiếu niêm yết tại Việt Nam làm thành phần hoặc cơ sở tính toán theo thỏa thuận hợp tác với Sở Giao dịch chứng khoán Việt Nam và công ty con.

2. *Kỳ cơ cấu chỉ số FTSE*: là khoảng thời gian thực hiện quy trình rà soát, đánh giá và điều chỉnh danh mục chỉ số theo quy tắc của FTSE Russell, bao gồm việc xác định dữ liệu đầu vào, đánh giá các tiêu chí lựa chọn, xác định hoặc điều chỉnh cổ phiếu thành phần, tỷ trọng và tỷ lệ đầu tư được, từ thời điểm chốt dữ liệu phục vụ kỳ rà soát đến thời điểm danh mục mới có hiệu lực và thời gian giám sát sau khi danh mục mới có hiệu lực.

3. *Ngày chốt dữ liệu*: là thời điểm kết thúc kỳ thu thập và xác định dữ liệu đầu vào phục vụ việc tính toán, phân loại và xác định cổ phiếu thành phần, tỷ trọng hoặc tỷ lệ đầu tư được theo bộ quy tắc áp dụng của FTSE Russell. Dữ liệu đầu vào có thể bao gồm vốn hóa, thanh khoản, tỷ lệ cổ phiếu tự do chuyển nhượng, giới hạn sở hữu nước ngoài và các dữ liệu khác theo quy tắc của từng bộ chỉ số.



4. *Ngày công bố thông tin*: là ngày FTSE Russell chính thức công bố kết quả rà soát, điều chỉnh danh mục, thành phần, tỷ trọng hoặc tỷ lệ đầu tư được của chỉ số ra công chúng theo quy định và lịch công bố áp dụng đối với từng bộ chỉ số.

5. *Ngày chỉ số có hiệu lực*: là ngày danh mục chỉ số và các thay đổi về thành phần, tỷ trọng hoặc tỷ lệ đầu tư được được FTSE Russell chính thức áp dụng để tính toán chỉ số.

Điều 4. Nguyên tắc giám sát tăng cường

1. Bảo đảm tính chủ động, liên tục, xuyên suốt trước, trong và sau các kỳ cơ cấu chỉ số trong hoạt động giám sát, nhằm kịp thời phát hiện giao dịch có dấu hiệu bất thường.

2. Bảo đảm đúng chức năng, nhiệm vụ, thẩm quyền và trách nhiệm của các đơn vị, cá nhân trong hoạt động giám sát.

3. Hoạt động giám sát theo Quy chế này được thực hiện đồng thời với các hoạt động giám sát khác theo quy định hiện hành, không thay thế hoặc làm ảnh hưởng đến việc thực hiện các hoạt động giám sát đó.

Điều 5. Thời gian thực hiện giám sát tăng cường

Hoạt động giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell được thiết lập theo chu trình 03 giai đoạn cụ thể như sau:

Giai đoạn 1: Từ ngày giao dịch liền trước ngày chốt dữ liệu đến ngày giao dịch liền trước ngày công bố thông tin.

Giai đoạn 2: Từ ngày công bố thông tin đến ngày giao dịch liền trước ngày chỉ số có hiệu lực.

Giai đoạn 3: Từ ngày chỉ số có hiệu lực đến hết 05 ngày giao dịch liền sau ngày chỉ số có hiệu lực.

Điều 6. Đối tượng giám sát tăng cường

1. Cổ phiếu có khả năng được thêm vào, loại ra khỏi thành phần chỉ số từ ngày chốt dữ liệu được FTSE Russell công bố thông tin.

2. Cổ phiếu chính thức được thêm vào, loại ra khỏi thành phần chỉ số được FTSE Russell công bố thông tin.

Điều 7. Nội dung giám sát

1. Giám sát giao dịch của tài khoản, nhóm tài khoản có dấu hiệu tác động đến giá hoặc thanh khoản.

2. Giám sát tài khoản, nhóm tài khoản có dấu hiệu tác động đến giá đóng cửa tại ngày giao dịch liền trước ngày chỉ số có hiệu lực.

3. Giám sát giao dịch của tài khoản, nhóm tài khoản có dấu hiệu sử dụng thông tin nội bộ trong mua bán chứng khoán.

Điều 8. Quy trình giám sát tăng cường

HOSE chủ trì xây dựng, ban hành và tổ chức triển khai thực hiện Quy trình giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell sau khi VNX chấp thuận.

Điều 9. Tiêu chí giám sát tăng cường

Trên cơ sở Bộ tiêu chí giám sát giao dịch chứng khoán do VNX ban hành và điều kiện thực tế của thị trường, HOSE xác định các tham số áp dụng cho tiêu chí giám sát cho hoạt động giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell, báo cáo VNX có ý kiến để áp dụng.

Điều 10. Trách nhiệm của các tổ chức có liên quan

1. Trách nhiệm của Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam

a) Chỉ đạo, giám sát và đôn đốc HOSE trong quá trình triển khai thực hiện hoạt động giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell.

b) Chấp thuận Quy trình giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell do HOSE xây dựng.

c) Có ý kiến đối với tham số áp dụng cho tiêu chí giám sát sử dụng cho hoạt động giám sát tăng cường đối với giao dịch chứng khoán trong kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell.

2. Trách nhiệm của Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh

a) Tổ chức thực hiện hoạt động giám sát theo quy định tại Quy chế này.

b) Yêu cầu thành viên giao dịch cung cấp thông tin, tài liệu để làm rõ các giao dịch có dấu hiệu nghi vấn trong các kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell theo quy định tại điểm b khoản 3 Điều 7 Thông tư số 95/2020/TT-BTC được sửa đổi, bổ sung tại Điều 5 Thông tư số 138/2025/TT-BTC.

c) Báo cáo Ủy ban Chứng khoán Nhà nước và VNX về các trường hợp có giao dịch nghi vấn trong kỳ cơ cấu chỉ số FTSE Russell theo quy định tại điểm c khoản 3 Điều 7 Thông tư số 95/2020/TT-BTC được sửa đổi, bổ sung tại Điều 5 Thông tư số 138/2025/TT-BTC.

3. Thành viên giao dịch có trách nhiệm cung cấp kịp thời, đầy đủ và chính xác thông tin, tài liệu khi HOSE và VNX yêu cầu theo quy định tại điểm b khoản 3 Điều 7 Thông tư số 95/2020/TT-BTC được sửa đổi, bổ sung tại Điều 5 Thông tư số 138/2025/TT-BTC.

Điều 11. Tổ chức thực hiện

1. Trường hợp văn bản pháp luật được ban hành sau khi Quy chế này có hiệu lực và có quy định khác với nội dung quy định tại Quy chế này thì thực hiện theo văn bản pháp luật đó cho đến khi Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam sửa đổi, bổ sung hoặc ban hành Quy chế thay thế.

2. Trong quá trình thực hiện, nếu có vướng mắc hoặc có vấn đề mới phát sinh, Sở Giao dịch Chứng khoán Thành phố Hồ Chí Minh phản ánh kịp thời về Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam để được hướng dẫn hoặc sửa đổi, bổ sung.

3. Việc sửa đổi, bổ sung Quy chế này do Hội đồng thành viên Sở Giao dịch Chứng khoán Việt Nam quyết định sau khi được Ủy ban Chứng khoán Nhà nước chấp thuận./. *Vu*

TM. HỘI ĐỒNG THÀNH VIÊN

CHỦ TỊCH



Lương Hải Sinh