

QUYẾT ĐỊNH CỦA THỐNG ĐỐC NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC

Về việc ban hành Quy chế nghiệp vụ thị trường mở

THỐNG ĐỐC NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC

Căn cứ Luật Ngân hàng Nhà nước Việt Nam số 01/1997/QH10 ngày 12/12/1997 và Luật Các tổ chức tín dụng số 01/1997/QH10 ngày 26/12/1997;

Căn cứ Nghị định số 15/CP ngày 02/03/1993 của Chính phủ về nhiệm vụ, quyền hạn và trách nhiệm quản lý Nhà nước của Bộ, cơ quan ngang Bộ;

Theo đề nghị của Vụ trưởng Vụ Tín dụng,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Ban hành kèm theo Quyết định này Quy chế nghiệp vụ thị trường mở

Điều 2. Quyết định này có hiệu lực thi hành sau 15 ngày kể từ ngày ký

Điều 3. Chánh Văn phòng, Vụ trưởng Vụ Chính sách tiền tệ, Giám đốc Sở Giao dịch Ngân hàng Nhà nước, Vụ trưởng Vụ Tín dụng, Thủ trưởng các đơn vị có liên quan thuộc Ngân hàng Nhà nước, Giám đốc Chi nhánh Ngân hàng Nhà nước tỉnh, thành phố trực thuộc Trung ương, Chủ tịch Hội đồng quản trị, Tổng Giám đốc (Giám đốc) các tổ chức tín dụng tham gia nghiệp vụ thị trường mở chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này./.

QUY CHẾ NGHIỆP VỤ THỊ TRƯỜNG MỞ

(Ban hành kèm theo Quyết định số 85 /2000/QĐ-NHNN14

ngày 9 tháng 3 năm 2000 của Thống đốc Ngân hàng Nhà nước)

CHƯƠNG I. QUY ĐỊNH CHUNG

Điều 1. Phạm vi điều chỉnh và đối tượng áp dụng

Quy chế này quy định việc mua, bán tín phiếu Kho bạc, chứng chỉ tiền gửi, tín phiếu Ngân hàng Nhà nước và các loại giấy tờ có giá ngắn hạn khác (sau đây gọi tắt là giấy tờ có giá) giữa Ngân hàng Nhà nước với các tổ chức tín dụng trên thị trường tiền tệ nhằm thực hiện chính sách tiền tệ quốc gia.

Điều 2. Giải thích từ ngữ

1. Thời hạn còn lại: Là thời gian thanh toán còn lại của giấy tờ có giá hạn, tính từ ngày giấy tờ có giá được mua, bán thông qua nghiệp vụ thị trường mở đến ngày đến hạn thanh toán.

2. Bán và cam kết mua lại (gọi tắt là giao dịch có kỳ hạn): Là việc bên bán (Ngân hàng Nhà nước hoặc tổ chức tín dụng) bán và chuyển giao quyền sở hữu giấy tờ có giá cho bên mua (tổ chức tín dụng hoặc Ngân hàng Nhà nước) đồng thời cam kết mua lại và nhận lại quyền sở hữu giấy tờ có giá đó sau một thời hạn nhất định.

3. Mua hoặc bán hẫng: Là việc mua, bán và chuyển giao quyền sở hữu giấy tờ có giá từ bên bán cho bên mua và không kèm theo thỏa thuận mua, bán lại giấy tờ có giá.

4. Đấu thầu khối lượng: Là việc xác định khối lượng trúng thầu của các tổ chức tín dụng tham gia nghiệp vụ thị trường mở trên cơ sở khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng, khối lượng giấy tờ có giá mua hoặc bán và lãi suất do Ngân hàng Nhà nước thông báo.

5. Đấu thầu lãi suất: Là việc xác định lãi suất trúng thầu của các tổ chức tín dụng tham gia nghiệp vụ thị trường mở trên cơ sở lãi suất dự thầu của các tổ chức tín dụng và khối lượng giấy tờ có giá mua hoặc bán do Ngân hàng Nhà nước thông báo.

6. Ngày thông báo: Là ngày Ngân hàng Nhà nước gửi thông báo về việc mua hoặc bán các giấy tờ có giá.

7. Ngày đấu thầu: Là ngày các tổ chức tín dụng nộp đơn dự thầu, Ngân hàng Nhà nước tổ chức xét thầu và thông báo kết quả đấu thầu.

8. Ngày thanh toán: Là ngày các tổ chức tín dụng trúng thầu thực hiện giao, nhận và thanh toán các giấy tờ có giá với Ngân hàng Nhà nước, sau 2 ngày kể từ ngày đấu thầu.

Điều 3. Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở

Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở được Ngân hàng Nhà nước thành lập do một Phó Thống đốc làm Trưởng ban và các thành viên là đại diện của các đơn vị có liên quan thuộc Ngân hàng Nhà nước. Ban điều hành nghiệp vụ Thị trường mở được tổ chức và hoạt động theo quy định của Thống đốc Ngân hàng Nhà nước.

Điều 4. Thành viên tham gia nghiệp vụ thị trường mở

Thành viên tham gia nghiệp vụ thị trường mở là các tổ chức tín dụng thành lập và hoạt động theo Luật Các tổ chức tín dụng có đủ điều kiện quy định tại Điều 5 Quy chế này.

Điều 5. Điều kiện tham gia thị trường mở

Các tổ chức tín dụng được công nhận là thành viên tham gia nghiệp vụ thị trường mở khi có đủ các điều kiện sau đây:

- 1.Có tài khoản tiền gửi tại Ngân hàng Nhà nước (Sở Giao dịch Ngân hàng Nhà nước hoặc chi nhánh Ngân hàng Nhà nước tỉnh, thành phố);
- 2.Có đủ các phương tiện cần thiết để tham gia nghiệp vụ thị trường mở gồm nối mạng máy vi tính với Ngân hàng Nhà nước, có máy FAX và điện thoại để giao dịch với Ngân hàng Nhà nước;
- 3.Có đăng ký tham gia nghiệp vụ thị trường mở (theo Phụ lục số 01/TTM đính kèm Quy chế này).

Điều 6: Công nhận thành viên tham gia nghiệp vụ thị trường mở

Các tổ chức tín dụng có đủ các điều kiện được quy định tại Điều 5 của Quy chế này, được Ngân hàng Nhà nước cấp giấy công nhận là thành viên của thị trường.

Điều 7. Ủy quyền tham gia giao dịch

Tổng Giám đốc (Giám đốc) tổ chức tín dụng là người quyết định và ký các giấy tờ có liên quan đến giao dịch nghiệp vụ Thị trường mở. Tổng Giám đốc (Giám đốc) có thể ủy quyền cho Phó Tổng Giám đốc (phó Giám đốc) hoặc Giám đốc Hội sở giao dịch hoặc Giám đốc chi nhánh của tổ chức tín dụng thực hiện các quyết định và ký các văn bản giao dịch Nghiệp vụ thị trường mở và phải chịu trách nhiệm về sự ủy quyền đó.

Điều 8. Các loại giấy tờ có giá được giao dịch thông qua thị trường mở

- 1.Tín phiếu Kho bạc.
- 2.Tín phiếu Ngân hàng Nhà nước.
- 3.Các loại giấy tờ có giá ngắn hạn khác do Thống đốc Ngân hàng Nhà nước quy định cụ thể trong từng thời kỳ.

Điều 9. Phương thức mua hoặc bán giấy tờ có giá

Ban Điều hành nghiệp vụ thị trường mở quyết định mỗi phiên giao dịch chỉ áp dụng một trong hai phương thức sau

- 1.Bán và cam kết mua lại (giao dịch có kỳ hạn).
- 2.Mua hoặc bán hẫng.

Điều 10. Cấp mã số giao dịch cho các tổ chức tín dụng

Các tổ chức tín dụng được Ngân hàng Nhà nước công nhận là thành viên tham gia nghiệp vụ thị trường mở được cấp mã số (code), mã khoá để giao dịch qua máy vi tính, máy FAX và mã số chữ ký cho những người đại diện được tổ chức tín dụng ủy quyền tham gia giao dịch để thực hiện chế độ bảo mật đối với các giao dịch nghiệp vụ thị trường mở.

Điều 11. Ngày giao dịch và định kỳ tổ chức thực hiện nghiệp vụ thị trường mở

- 1.Ngày giao dịch nghiệp vụ Thị trường mở được tính theo ngày làm việc, không tính ngày nghỉ cuối tuần, nghỉ lễ và nghỉ tết.

2. Định kỳ và ngày tổ chức thực hiện nghiệp vụ thị trường mở do Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở quy định cụ thể trong từng thời kỳ.

CHƯƠNG II. QUY ĐỊNH CỤ THỂ

Điều 12. Điều kiện giao dịch thông qua thị trường mở của giấy tờ có giá

Các giấy tờ có giá quy định Điều 8 của Quy chế này được giao dịch thông qua nghiệp vụ thị trường mở phải có đủ điều kiện sau đây:

1. Có thể giao dịch được;
2. Được phát hành bằng đồng Việt Nam;
3. Đăng ký tại Ngân hàng Nhà nước theo quy định về việc đăng ký giấy tờ có giá ngắn hạn của Ngân hàng Nhà nước;
4. Giấy tờ có giá được mua, bán hẳn phải có thời hạn còn lại tối đa là 90 ngày.

Điều 13. Phương thức đấu thầu

Việc mua hoặc bán các loại giấy tờ có giá giữa Ngân hàng Nhà nước với các tổ chức tín dụng thực hiện thông qua phương thức đấu thầu khối lượng hoặc đấu thầu lãi suất.

1. Đấu thầu khối lượng

- a. Ngân hàng Nhà nước thông báo cho các tổ chức tín dụng mức lãi suất và khối lượng các loại giấy tờ có giá cần mua hoặc cần bán.
- b. Tổ chức tín dụng dự thầu khối lượng các loại giấy tờ có giá cần mua hoặc cần bán theo mức lãi suất Ngân hàng Nhà nước thông báo.
- c. Trường hợp tổng khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng bằng hoặc thấp hơn khối lượng Ngân hàng Nhà nước cần mua hoặc cần bán thì khối lượng trúng thầu của từng tổ chức tín dụng là khối lượng dự thầu của tổ chức tín dụng đó.
- d. Trường hợp tổng khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng vượt quá khối lượng Ngân hàng Nhà nước cần mua hoặc cần bán, khối lượng giấy tờ có giá trúng thầu được phân bổ theo tỷ lệ thuận với khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng và được làm tròn đến 10 triệu đồng.

2. Đấu thầu lãi suất

- a. Ngân hàng Nhà nước công bố khối lượng các loại giấy tờ có giá cần mua hoặc cần bán.
- b. Tổ chức tín dụng dự thầu theo các mức lãi suất và khối lượng giấy tờ có giá cần mua, cần bán tương ứng với các mức lãi suất đó. Lãi suất dự thầu được tính theo tỷ lệ %/năm và được làm tròn đến 2 con số sau dấu phẩy.

c. Các đơn dự thầu của các tổ chức tín dụng được xếp theo thứ tự lãi suất dự thầu giảm dần trong trường hợp Ngân hàng Nhà nước mua giấy tờ có giá, hoặc lãi suất dự thầu tăng dần trong trường hợp Ngân hàng Nhà nước bán giấy tờ có giá.

d. Lãi suất trúng thầu là lãi suất dự thầu thấp nhất (trường hợp Ngân hàng Nhà nước mua giấy tờ có giá) hoặc lãi suất dự thầu cao nhất (trường hợp Ngân hàng Nhà nước bán giấy tờ có giá) mà tại mức lãi suất đó đạt được khối lượng giấy tờ có giá Ngân hàng Nhà nước cần mua hoặc cần bán.

e. Khối lượng trúng thầu của các tổ chức tín dụng là khối lượng của các mức dự thầu có lãi suất bằng và cao hơn mức lãi suất trúng thầu (trường hợp Ngân hàng Nhà nước mua giấy tờ có giá) hoặc có lãi suất dự thầu bằng và thấp hơn lãi suất trúng thầu (trường hợp Ngân hàng Nhà nước bán giấy tờ có giá).

g. Trong từng thời kỳ, Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở sẽ thông báo việc áp dụng phương thức xét thầu theo mức lãi suất thống nhất hoặc lãi suất riêng lẻ.

- Lãi suất thống nhất: Toàn bộ khối lượng trúng thầu được tính thống nhất theo mức lãi suất trúng thầu.

- Lãi suất riêng lẻ: Từng mức khối lượng trúng thầu được tính tương ứng với từng mức lãi suất dự thầu.

h. Trường hợp tại mức lãi suất trúng thầu, tổng khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng vượt quá khối lượng giấy tờ có giá Ngân hàng Nhà nước cần mua hoặc cần bán, thì khối lượng giấy tờ có giá trúng thầu của các tổ chức tín dụng tại mức lãi suất trúng thầu được tính theo tỷ lệ thuận với khối lượng dự thầu của các tổ chức tín dụng tại mức lãi suất trúng thầu và được làm tròn đến 10 triệu đồng; Trường hợp tại mức lãi suất trúng thầu của một tổ chức tín dụng có nhiều loại giấy tờ có giá cần bán hoặc cần mua, Ngân hàng Nhà nước xét thầu xác định theo thứ tự từng loại giấy tờ có giá như sau:

- Giấy tờ có giá đăng ký bán hoặc đăng ký mua có khối lượng lớn hơn.

- Giấy tờ có giá có thời hạn bán hoặc mua ngắn hơn (trường hợp mua hoặc bán hần).

- Thời hạn còn lại của giấy tờ có giá ngắn hơn.

Điều 14. Xác định khối lượng, thời hạn giấy tờ có giá cần mua, cần bán

1. Từ 8 giờ đến 10 giờ ngày thông báo, Trưởng Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở hoặc Phó Trưởng ban được Trưởng ban uỷ quyền họp với các thành viên trong Ban Điều hành Nghiệp vụ thị trường mở để xác định các nội dung chính như sau:

a. Khối lượng các loại giấy tờ có giá cần mua hoặc cần bán;

b. Phương thức đấu thầu;

c. Phương thức xét thầu (Trường hợp đấu thầu lãi suất);

d. Thời hạn của giao dịch mua bán có kỳ hạn;

e. Lãi suất mua hoặc bán (Trường hợp đấu thầu khối lượng).

2. Việc xác định các nội dung trên dựa vào các căn cứ sau đây: