

THÔNG TƯ
Quy định về nghiệp vụ thị trường mở

Căn cứ Luật Ngân hàng Nhà nước Việt Nam số 46/2010/QH12 ngày 16 tháng 6 năm 2010;

Căn cứ Luật các tổ chức tín dụng số 47/2010/QH12 ngày 16 tháng 6 năm 2010;

Căn cứ Nghị định số 156/2013/NĐ-CP ngày 11 tháng 11 năm 2013 của Chính phủ quy định chức năng, nhiệm vụ, quyền hạn và cơ cấu tổ chức của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam;

Theo đề nghị của Vụ trưởng Vụ Chính sách tiền tệ;

Thống đốc Ngân hàng Nhà nước Việt Nam ban hành Thông tư quy định về nghiệp vụ thị trường mở.

Chương I

QUY ĐỊNH CHUNG

Điều 1. Phạm vi điều chỉnh

Thông tư này quy định việc tổ chức thực hiện nghiệp vụ thị trường mở tại Ngân hàng Nhà nước Việt Nam (sau đây gọi tắt là Ngân hàng Nhà nước).

Điều 2. Đối tượng áp dụng

1. Các đơn vị thuộc Ngân hàng Nhà nước.

2. Các tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài được thành lập, hoạt động theo Luật các tổ chức tín dụng (trừ tổ chức tài chính vi mô, quỹ tín dụng nhân dân) và được Ngân hàng Nhà nước công nhận là thành viên nghiệp vụ thị trường mở (sau đây gọi tắt là thành viên).

Điều 3. Giải thích từ ngữ

1. Nghiệp vụ thị trường mở là việc Ngân hàng Nhà nước thực hiện mua, bán giấy tờ có giá với các thành viên.

2. Mua có kỳ hạn là việc Ngân hàng Nhà nước mua giấy tờ có giá và nhận quyền sở hữu giấy tờ có giá từ thành viên, đồng thời thành viên cam kết sẽ mua lại giấy tờ có giá đó sau một thời gian nhất định.

3. Bán có kỳ hạn là việc Ngân hàng Nhà nước bán giấy tờ có giá và chuyển quyền sở hữu giấy tờ có giá cho thành viên, đồng thời cam kết sẽ mua lại giấy tờ có giá đó sau một thời gian nhất định.

4. Mua hẳn là việc Ngân hàng Nhà nước mua giấy tờ có giá và nhận quyền sở hữu giấy tờ có giá từ thành viên, không kèm theo cam kết bán lại giấy tờ có giá.

5. Bán hẳn là việc Ngân hàng Nhà nước bán giấy tờ có giá và chuyển quyền sở hữu giấy tờ có giá cho thành viên, không kèm theo cam kết mua lại giấy tờ có giá.

6. Đấu thầu khối lượng là việc xét thầu trên cơ sở khối lượng giấy tờ có giá dự thầu của các thành viên, khối lượng giấy tờ có giá cần mua hoặc bán của Ngân hàng Nhà nước và lãi suất do Ngân hàng Nhà nước thông báo.

7. Đấu thầu lãi suất là việc xét thầu trên cơ sở lãi suất dự thầu, khối lượng giấy tờ có giá dự thầu của các thành viên và lãi suất xét thầu của Ngân hàng Nhà nước, khối lượng giấy tờ có giá cần mua hoặc bán của Ngân hàng Nhà nước.

8. Phương thức xét thầu đơn giá là phương thức mà toàn bộ khối lượng trúng thầu được tính thống nhất theo một mức lãi suất trúng thầu.

9. Phương thức xét thầu đa giá là phương thức mà từng mức khối lượng trúng thầu được tính tương ứng với từng mức lãi suất dự thầu được xét là lãi suất trúng thầu.

10. Ngày thông báo là ngày Ngân hàng Nhà nước thông báo việc mua hoặc bán giấy tờ có giá.

11. Ngày đấu thầu là ngày Ngân hàng Nhà nước tổ chức đấu thầu, xét thầu, thông báo kết quả đấu thầu.

12. Ngày mua là ngày mà giấy tờ có giá được Bên bán chuyển quyền sở hữu cho Bên mua và Bên mua thanh toán tiền mua giấy tờ có giá cho Bên bán.

13. Ngày mua lại là ngày Bên mua thực hiện chuyển lại quyền sở hữu giấy tờ có giá đã mua (đối với giao dịch mua, bán có kỳ hạn) cho Bên bán và Bên bán thanh toán tiền mua lại giấy tờ có giá cho Bên mua theo giá mua lại.

14. Tỷ lệ chênh lệch giữa giá trị giấy tờ có giá tại thời điểm định giá với giá thanh toán (haircut) là tỷ lệ phần trăm chênh lệch giữa giá trị giấy tờ có giá tại thời điểm định giá trong giao dịch mua, bán có kỳ hạn giấy tờ có giá và giá thanh toán giữa Ngân hàng Nhà nước với thành viên do Ngân hàng Nhà nước quy định trong từng thời kỳ.

15. Tỷ lệ giao dịch của các loại giấy tờ có giá là tỷ lệ giá trị giao dịch (giá thanh toán giữa Ngân hàng Nhà nước với các thành viên) của các loại giấy tờ có giá tham gia giao dịch nghiệp vụ thị trường mở.

16. Thời hạn mua, bán có kỳ hạn giấy tờ có giá là khoảng thời gian được tính từ ngày tiếp theo của ngày mua đến ngày mua lại, bao gồm cả ngày nghỉ, ngày lễ và được tính theo ngày.

17. Thời hạn còn lại của giấy tờ có giá là khoảng thời gian tính từ ngày tổ chức phiên mua, bán đến ngày đến hạn thanh toán toàn bộ gốc của giấy tờ có giá đó.

Điều 4. Ban Điều hành nghiệp vụ thị trường mở

1. Ban điều hành nghiệp vụ thị trường mở (sau đây gọi tắt là Ban điều hành) thay mặt Thống đốc Ngân hàng Nhà nước điều hành nghiệp vụ thị trường mở theo quy định tại Thông tư này. Thống đốc Ngân hàng Nhà nước quyết định về việc thành lập và hoạt động của Ban điều hành.

2. Ban điều hành có nhiệm vụ, quyền hạn sau:

- a) Điều hành nghiệp vụ thị trường mở;
- b) Quyết định định hướng điều hành nghiệp vụ thị trường mở trong từng thời kỳ;
- c) Xử lý các vấn đề phát sinh trong quá trình điều hành nghiệp vụ thị trường mở.

Điều 5. Điều kiện đối với thành viên nghiệp vụ thị trường mở

Tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài (trừ tổ chức tài chính vi mô, quỹ tín dụng nhân dân) được công nhận là thành viên khi đáp ứng đầy đủ các điều kiện sau đây:

1. Có tài khoản thanh toán bằng đồng Việt Nam tại Ngân hàng Nhà nước.
2. Được Ngân hàng Nhà nước cấp mã ngân hàng.

Điều 6. Thủ tục công nhận thành viên nghiệp vụ thị trường mở

1. Tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài có nhu cầu tham gia nghiệp vụ thị trường mở gửi trực tiếp hoặc qua đường bưu điện Giấy đề nghị tham gia nghiệp vụ thị trường mở theo Phụ lục số 01/TTM đính kèm Thông tư này đến Ngân hàng Nhà nước để được xem xét cấp Giấy công nhận thành viên nghiệp vụ thị trường mở.

2. Trong thời hạn 05 ngày làm việc kể từ ngày nhận được Giấy đề nghị tham gia nghiệp vụ thị trường mở của tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài, Ngân hàng Nhà nước thực hiện việc cấp Giấy công nhận thành viên nghiệp vụ thị trường mở khi đủ điều kiện quy định tại Điều 5 Thông tư này hoặc có văn bản trả lời cho tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài nếu không đủ điều kiện.

3. Thủ tục công nhận lại thành viên đối với trường hợp thành viên đã chấm dứt tư cách thành viên theo quy định tại điểm b khoản 1 và khoản 2 Điều 7 Thông tư này được thực hiện như thủ tục công nhận thành viên lần đầu.

Điều 7. Chấm dứt tư cách thành viên

1. Thành viên bị chấm dứt tư cách thành viên trong các trường hợp sau:

a) Thành viên bị tự động chấm dứt tư cách thành viên khi thành viên bị sáp nhập, hợp nhất, chia tách, giải thể, phá sản;

b) Khi tài khoản thanh toán bằng đồng Việt Nam tại Ngân hàng Nhà nước của thành viên bị đóng, Ngân hàng Nhà nước có văn bản thông báo về việc chấm dứt tư cách thành viên.

2. Thành viên có nhu cầu chấm dứt tư cách thành viên và hoàn thành các nghĩa vụ đối với Ngân hàng Nhà nước trong các giao dịch nghiệp vụ thị trường mở, gửi trực tiếp hoặc qua đường bưu điện Giấy đề nghị chấm dứt tư cách thành viên theo Phụ lục số 02/TTM đính kèm Thông tư này đến Ngân hàng Nhà nước. Trong thời hạn 05 ngày làm việc kể từ ngày nhận được Giấy đề nghị chấm dứt tư cách thành viên, Ngân hàng Nhà nước có văn bản thông báo về việc chấm dứt tư cách thành viên gửi cho thành viên.

3. Khi chấm dứt tư cách thành viên, Sở Giao dịch Ngân hàng nhà nước (sau đây gọi tắt là Sở Giao dịch) thông báo cho Cục Công nghệ tin học để thu hồi mã khóa truy cập và mã khóa ký chữ ký điện tử của thành viên.

Điều 8. Thẩm quyền ký trong giao dịch nghiệp vụ thị trường mở

1. Người có thẩm quyền thay mặt tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài ký các văn bản liên quan đến việc đề nghị công nhận, chấm dứt tư cách thành viên và văn bản liên quan đến việc thực hiện giao dịch nghiệp vụ thị trường mở với Ngân hàng Nhà nước là người đại diện hợp pháp của tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài.

2. Giám đốc Sở Giao dịch là người có thẩm quyền (hoặc có thể uỷ quyền cho Phó Giám đốc Sở Giao dịch và chịu trách nhiệm về sự uỷ quyền này) ký các văn bản liên quan đến việc công nhận, chấm dứt tư cách thành viên và văn bản liên quan đến việc thực hiện giao dịch nghiệp vụ thị trường mở với thành viên.

Điều 9. Cấp mã khóa truy cập, mã khóa ký chữ ký điện tử và phân quyền cho thành viên

Khi tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài được công nhận là thành viên, Ngân hàng Nhà nước cấp mã khóa truy cập, mã khóa ký chữ ký điện tử và phân quyền cho nhân sự tham gia giao dịch nghiệp vụ thị trường mở theo đề nghị của thành viên.

Việc cấp mã khóa truy cập, mã khóa ký chữ ký điện tử do Cục Công nghệ tin học thực hiện phù hợp với quy định của Ngân hàng Nhà nước về việc quản lý, sử dụng chữ ký số, chứng thư số và dịch vụ chứng thực chữ ký số của Ngân hàng Nhà nước. Việc phân quyền cho nhân sự tham gia giao dịch nghiệp vụ thị trường mở của thành viên do Sở Giao dịch thực hiện theo Quy trình nghiệp vụ thị trường mở.

Điều 10. Giấy tờ có giá được giao dịch qua nghiệp vụ thị trường mở

1. Các loại giấy tờ có giá được Ngân hàng Nhà nước chấp nhận giao dịch nghiệp vụ thị trường mở phải có đủ các điều kiện sau đây:

- a) Có thể chuyển nhượng và nằm trong danh mục các loại giấy tờ có giá được giao dịch qua nghiệp vụ thị trường mở;
- b) Thuộc quyền sở hữu hợp pháp của thành viên;
- c) Được phát hành bằng đồng Việt Nam;
- d) Lưu ký trực tiếp tại Ngân hàng Nhà nước hoặc lưu ký tại tài khoản khách hàng của Ngân hàng Nhà nước tại Trung tâm lưu ký chứng khoán Việt Nam trước khi đăng ký bán giấy tờ có giá cho Ngân hàng Nhà nước;
- đ) Thời hạn còn lại của giấy tờ có giá trong giao dịch mua, bán có kỳ hạn phải lớn hơn thời hạn giao dịch mua, bán có kỳ hạn theo thông báo của Ngân hàng Nhà nước; Giấy tờ có giá chỉ được đăng ký bán trước ngày đăng ký cuối cùng thanh toán lãi và gốc giấy tờ có giá đáo hạn.

2. Danh mục các loại giấy tờ có giá được giao dịch nghiệp vụ thị trường mở, tỷ lệ chênh lệch giữa giá trị giấy tờ có giá tại thời điểm định giá với giá thanh toán do Thống đốc Ngân hàng Nhà nước quyết định.

Điều 11. Phương thức mua hoặc bán giấy tờ có giá

- 1. Mua có kỳ hạn.
- 2. Bán có kỳ hạn.
- 3. Mua hần.
- 4. Bán hần.

Điều 12. Ngày giao dịch

Các giao dịch nghiệp vụ thị trường mở được thực hiện vào ngày làm việc. Trường hợp ngày mua lại hoặc ngày đến hạn thanh toán của giấy tờ có giá không trùng với ngày làm việc thì việc thanh toán và chuyển quyền sở hữu giấy tờ có giá được thực hiện vào ngày làm việc liền kề tiếp theo và chỉ tính lãi theo thời hạn mua, bán.

Điều 13. Quy trình nghiệp vụ thị trường mở

- 1. Quy trình nghiệp vụ thị trường mở hướng dẫn các nội dung cơ bản sau:
 - a) Công nhận, chấm dứt tư cách thành viên nghiệp vụ thị trường mở;
 - b) Ngân hàng Nhà nước và thành viên ký, giao, nhận Hợp đồng khung mua/bán giấy tờ có giá;
 - c) Ngân hàng Nhà nước (Sở Giao dịch) thông báo mua, bán giấy tờ có giá;
 - d) Thành viên lưu ký giấy tờ có giá;
 - đ) Thành viên nộp đơn dự thầu;
 - e) Ngân hàng Nhà nước (Sở giao dịch) tổ chức xét thầu;