

คู่มือการปฏิบัติงานสำหรับการดำเนินนโยบายอัตราแลกเปลี่ยน (FX Operations Guidelines)

<p>การประชุม คณะกรรมการนโยบาย การเงิน (กนง.) (ทุก 6-8 สัปดาห์)</p>	<ul style="list-style-type: none">• พิจารณานโยบายอัตราแลกเปลี่ยนที่เหมาะสม• พิจารณา/เตรียมความพร้อมของเครื่องมือการเข้าดูแล• พิจารณาวางเงิน หากต้องเข้าดูแลอัตราแลกเปลี่ยน• ประเมินภาวะตลาด
<p>คณะอนุกรรมการตลาดเงิน (อนต.) (ทุก 2 สัปดาห์)</p>	<ul style="list-style-type: none">• ทหารือเพื่อเสนอแนะนโยบายอัตราแลกเปลี่ยนที่เหมาะสม• บริหารจัดการการเข้าดูแลอัตราแลกเปลี่ยน• ประเมินภาวะตลาด
<p>ฝ่ายตลาดการเงิน (ผตง.) (ทุกวัน)</p>	<ul style="list-style-type: none">• ติดตามภาวะตลาดอัตราแลกเปลี่ยนและแรงกดดันค่าเงินบาทอย่างใกล้ชิด• ดำเนินการในการดูแลค่าเงินบาทตามมติ กนง. และ อนต.• เสนอแนะแนวทางการเข้าดูแลที่เหมาะสมกับสถานการณ์

คู่มือการปฏิบัติงานสำหรับการดำเนินนโยบายอัตราแลกเปลี่ยน (FX Operations Guidelines)

ขั้นตอนการทำธุรกรรมการดำเนินนโยบายอัตราแลกเปลี่ยน (Spot+Swap)

Mandate ของ กนง.	<ul style="list-style-type: none">• กนง. ให้นโยบายและกำหนดวงเงินในการดูแลด้านอัตราแลกเปลี่ยนในแต่ละรอบการประชุม• อนาคต. กำหนดกลยุทธ์การดูแลภายใต้ mandate ของ กนง. รวมทั้งกำหนดวงเงิน• ฝตง. ดำเนินการเข้าดูแลอัตราแลกเปลี่ยนตามแนวทางของ กนง. และ อนาคต.
การทำธุรกรรม	<ul style="list-style-type: none">• ฝตง. ทหารือแนวทางการดูแล ภายใต้วงเงินที่ได้รับอนุมัติจากผู้บริหารตามลำดับขั้น• ฝตง. ดำเนินการตรวจสอบ limit คู่ค้าในรายชื่อคู่ค้าที่ได้รับการอนุมัติจากฝ่ายบริหารความเสี่ยง• ฝตง. เข้าทำธุรกรรมกับคู่ค้า โดยวางคำสั่งซื้อ/ขาย• Key-in รายการในระบบ Dealing Room System• Verify ธุรกรรม เพื่อส่งต่อให้ Back Office
การชำระราคา	<ul style="list-style-type: none">• ธปท. และ คู่ค้าตรวจสอบความถูกต้องของรายการธุรกรรม (verification) และยืนยันการทำธุรกรรม (confirmation)• ธปท. หรือคู่ค้า ธปท. ชำระราคา (settlement) ภายในเวลาที่กำหนด