

特 急

中国人民银行文件

银发〔2006〕316号

中国人民银行关于构建中国货币市场 基准利率有关事宜的通知

全国银行间同业拆借中心,中国工商银行、中国农业银行、中国银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、中信银行、中国光大银行、兴业银行、上海浦东发展银行、北京银行、上海银行、南京市商业银行、德意志银行上海分行、汇丰银行上海分行、渣打银行上海分行:

为提高金融机构的自主定价能力,指导货币市场产品定价,稳步推进利率市场化,完善货币政策调控机制,中国人民银行决定建立报价制的中国货币市场基准利率。现就有关事宜通知如下:

一、中国货币市场基准利率的定义和名称。中国货币市场基准利率是根据信用等级较高的银行报出的人民币同业拆出利率计算确定的算术平均利率,是单利、无担保、批发性利率。该利率以位于上海的全国银行间同业拆借中心(以下简称同业拆借中心)为技术平台计算并发布,命名为“上海银行间同业拆放利率”

(Shanghai Interbank Offered Rate, 简称 Shibor)。

二、制定下发 Shibor 实施准则。《Shibor 实施准则(试行)》(以下简称《准则》,见附件 1)规范了 Shibor 的形成机制、信息发布机制和监督管理机制,请各有关金融机构遵照执行。

三、组建报价银行团。根据商业银行是否具有公开市场一级交易商或外汇市场做市商资格以及各商业银行的货币市场交易量、信用等级、定价能力、信息披露等条件,在试运行期间初步选择 16 家商业银行组成首批 Shibor 报价银行团(具体名单见附件 2),负责在每个交易日向上海银行间同业拆放利率网提供各期限档次的拆出、拆入双边报价。根据报价质量,对报价行按年实行末位淘汰制。

四、授权同业拆借中心计算和发布 Shibor。授权同业拆借中心为 Shibor 的指定发布人,负责 Shibor 的报价、计算、信息发布、信息监控和备份等相关技术系统的开发,以及上海银行间同业拆放利率网的日常维护;每个交易日根据各报价行的报价,按照《准则》的要求计算 Shibor,并于 11:30 对外发布。

五、Shibor 的品种。Shibor 由隔夜、1 周、2 周、1 个月、3 个月、6 个月、9 个月及 1 年共 8 个公布品种和 3 周、2 个月、4 个月、5 个月、7 个月、8 个月、10 个月、11 个月共 8 个参考品种组成。利率品种代码按期限长短排列为 O/N、1W、2W、3W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、7M、8M、9M、10M、11M、1Y(O/N 代表隔夜,W 代表周,M 代表月,Y 代表年)。

六、分步实施 Shibor 的构建工作。发文之日至 2006 年 9 月 30 日为构建 Shibor 的筹备期,做好 Shibor 运行的各项准备工作。2006 年 10 月 8 日至 2006 年 12 月 31 日为 Shibor 的试运行阶段:

10月8日至11月30日为报价行内部试运行期,不对银行间市场成员公布;12月1日至年底为外部试运行期,将**Shibor**及相关规范性文件对银行间市场公布。试运行期间不对外公布**Shibor**。自2007年开始,**Shibor**正式投入运行,届时人民银行总行统一对外公告和宣传。

七、报价行要认真做好**Shibor**的建设工作。各报价行对**Shibor**的建设工作要高度重视,认真负责,按照《准则》要求建立健全报价所需的规章制度、完善报价业务流程、准备相关的技术系统和人力保障,确保报价的各项准备工作按时完成,并将有关准备情况于2006年9月20日前以书面形式上报人民银行总行。**Shibor**建立后,各报价行每个交易日必须按时报价,并对报价质量负责,建立相应的应急机制,确保报价利率真正成为本行资产负债市场化定价的基准。各报价行每月向人民银行总行上报本行**Shibor**报价分析报告,对出现的新情况、新问题要及时处理并同时上报。

八、同业拆借中心要切实履行指定发布人职责。同业拆借中心要按照《准则》规定的内容和要求,成立专门的项目小组,配备专职人员,完成**Shibor**建设的各项工作。筹备期间,负责做好**Shibor**建设的各项技术准备工作,组织商业银行报价人员及**Shibor**信息发布人员进行相关技术培训,确保**Shibor**按时运行。试运行期间,负责做好**Shibor**的系统维护和运行监测,建立相应的应急机制,对**Shibor**的安全运行和信息发布负责。同业拆借中心必须定期(每周、每月、每季)向人民银行总行上报**Shibor**监测报告、各行报价及其质量考评情况等,及时处理和上报出现的新情况和新问题。

附件：**1. Shibor 实施准则(试行)**

2. 首批 Shibor 报价行名单

二〇〇六年九月六日

附件 1

Shibor 实施准则（试行）

目 录

第一章	总 则
第二章	报价银行团构成
第三章	报价行职责
第四章	指定发布人及其职责
第五章	工作小组的运行机制
第六章	监督管理
第七章	附 则

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=11_717

