|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | 交银银行间市场流动性指数（IBLI） |  |
|  | 发布时间：2018年6月12日 11：00（北京）分析人员：陈冀 电话：+86-21-32169999-1050Email: chenj\_495@bankcomm.com | 交通银行金融研究中心 |

**最新“艾布力”指数：**

IBLI： 1.13；风险状况：正常

**近日指数概览：**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 日期 | 同业拆借市场加权利率 | 质押式回购市场加权利率 | IBLI | 风险状况 |
|  2018/6/1 | 2.9374 | 3.0451 | -141.09  | 正常 |
|  2018/6/4 | 2.718 | 2.8066 | -51.79  | 正常 |
|  2018/6/5 | 2.6806 | 2.7368 | -2.41  | 正常 |
|  2018/6/6 | 2.6619 | 2.7215 | -0.25  | 正常 |
|  2018/6/7 | 2.6424 | 2.7028 | -1.16  | 正常 |
|  2018/6/8 | 2.6547 | 2.7142 | 0.14  | 正常 |
|  2018/6/11 | 2.6875 | 2.7435 | 1.13  | 正常 |

**近日指数趋势：**

数据来源： CEIC；交银金研中心流动性指数模型测算

**备注：**

* 交银银行间市场流动性指数（BoCOM Inter-Bank market Liquidity Index, IBLI）是以银行间同业拆借市场和银行间质押式回购市场交易数据（频率：天；来源：CEIC，网址：www.ceicdata.com）为基础，通过对不同期限（隔夜、7天、…、1月）分市场进行流动性指数模型测算，并进一步构建的反映当前银行间市场整体流动性状况的综合性指数。IBLI高于200，表明当前市场流动性趋紧、风险高；IBLI位于40~200之间，表明市场流动性已有趋紧态势，风险较高；5~40表明市场流动性有可能向趋紧的趋势转化，需关注；低于5，则表明市场流动性合理充裕，正常运行。
* 柱状图高低反映了流动性风险的强弱，柱状线越高，流动性愈加趋紧。通过柱状线各个时间点高低起伏变化，可历史的比较，过去与当前市场流动性变化的趋势。不同期限柱状线在当日柱状线上的长度占比，反映了当前市场流动性需求的期限结构状况。