

以下信息根据中国银监会《商业银行流动性覆盖率信息披露办法》附件 1《高级法银行流动性覆盖率定量信息披露模板》的规定披露。

### 流动性覆盖率定量信息

单位：人民币百万元，百分比除外

序号		2017 年第三季度	
		折算前数值	折算后数值
<b>合格优质流动性资产</b>			
1	合格优质流动性资产		4,637,340
<b>现金流出</b>			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	9,247,473	921,705
3	稳定存款	47,708	1,729
4	欠稳定存款	9,199,765	919,976
5	无抵（质）押批发融资，其中：	11,212,813	3,833,678
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	6,231,650	1,511,986
7	非业务关系存款（所有交易对手）	4,922,292	2,262,821
8	无抵（质）押债务	58,871	58,871
9	抵（质）押融资		36,835
10	其他项目，其中：	3,567,395	1,244,129
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	1,035,145	1,035,145
12	与抵（质）押债务工具融资流失相关的现金流出	-	-
13	信用便利和流动性便利	2,532,250	208,984
14	其他契约性融资义务	48,423	48,021
15	或有融资义务	1,193,213	27,954
16	<b>预期现金流出总量</b>		<b>6,112,322</b>
<b>现金流入</b>			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	889,811	282,932
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,477,586	1,061,236
19	其他现金流入	1,051,890	1,040,492
20	<b>预期现金流入总量</b>	<b>3,419,287</b>	<b>2,384,660</b>
			调整后数值
21	<b>合格优质流动性资产</b>		<b>4,637,340</b>
22	<b>现金净流出量</b>		<b>3,727,662</b>
23	<b>流动性覆盖率（%）</b>		<b>124.46%</b>

注：上表中各项数据均为最近一个季度内 92 个自然日数值的简单算术平均值。