

以下信息根据原中国银监会《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		2018 年第三季度	
		折算前数值	折算后数值
合格优质流动性资产			
1	合格优质流动性资产		4,973,338
现金流出			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	9,787,465	975,698
3	稳定存款	47,640	1,716
4	欠稳定存款	9,739,825	973,982
5	无抵（质）押批发融资，其中：	11,841,891	3,975,228
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	6,714,289	1,630,262
7	非业务关系存款（所有交易对手）	5,064,097	2,281,461
8	无抵（质）押债务	63,505	63,505
9	抵（质）押融资		30,640
10	其他项目，其中：	4,122,818	1,541,367
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	1,312,324	1,312,324
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	2,810,494	229,043
14	其他契约性融资义务	49,356	49,002
15	或有融资义务	2,916,258	120,122
16	预期现金流出总量		6,692,057
现金流入			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	826,569	334,358
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,291,643	919,100
19	其他现金流入	1,310,972	1,307,290
20	预期现金流入总量	3,429,184	2,560,748
			调整后数值
21	合格优质流动性资产		4,973,338
22	现金净流出量		4,131,309
23	流动性覆盖率（%）		120.36%

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。