

以下信息根据《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		2020年第一季度	
		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		5,361,279
现金流出			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	11,754,598	1,170,437
3	稳定存款	76,526	2,630
4	欠稳定存款	11,678,072	1,167,807
5	无抵（质）押批发融资，其中：	12,717,838	4,287,647
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	7,205,992	1,749,813
7	非业务关系存款（所有交易对手）	5,424,607	2,450,595
8	无抵（质）押债务	87,239	87,239
9	抵（质）押融资		14,997
10	其他项目，其中：	3,020,422	944,182
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	771,113	771,113
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	2,249,309	173,069
14	其他契约性融资义务	65,865	65,234
15	或有融资义务	4,175,549	125,554
16	预期现金流出总量		6,608,051
现金流入			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	752,981	321,617
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,411,562	995,260
19	其他现金流入	748,500	743,089
20	预期现金流入总量	2,913,043	2,059,966
			调整后数值
21	合格优质流动性资产		5,361,279
22	现金净流出量		4,548,085
23	流动性覆盖率（%）		118.05%

注：上表中各项数据均为最近一个季度内91个自然日数值的简单算术平均值。