

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 | | 5,496,598 |
| 现金流出 | | | |
| 2 | 零售存款、小企业客户存款，其中： | 12,190,310 | 1,213,404 |
| 3 | 稳定存款 | 86,217 | 2,995 |
| 4 | 欠稳定存款 | 12,104,093 | 1,210,409 |
| 5 | 无抵（质）押批发融资，其中： | 14,452,687 | 4,842,653 |
| 6 | 业务关系存款（不包括代理行业务） | 8,532,696 | 2,077,623 |
| 7 | 非业务关系存款（所有交易对手） | 5,839,003 | 2,684,042 |
| 8 | 无抵（质）押债务 | 80,988 | 80,988 |
| 9 | 抵（质）押融资 | | 12,301 |
| 10 | 其他项目，其中： | 3,322,216 | 1,469,917 |
| 11 | 与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出 | 1,314,437 | 1,314,437 |
| 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 | 2,007,779 | 155,480 |
| 14 | 其他契约性融资义务 | 65,372 | 65,372 |
| 15 | 或有融资义务 | 4,702,310 | 126,323 |
| 16 | 预期现金流出总量 | | 7,729,970 |
| 现金流入 | | | |
| 17 | 抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券） | 1,081,072 | 716,586 |
| 18 | 完全正常履约付款带来的现金流入 | 1,736,527 | 1,303,365 |
| 19 | 其他现金流入 | 1,313,105 | 1,309,058 |
| 20 | 预期现金流入总量 | 4,130,704 | 3,329,009 |
| | | | 调整后数值 |
| 21 | 合格优质流动性资产 | | 5,496,598 |
| 22 | 现金净流出量 | | 4,400,961 |
| 23 | 流动性覆盖率（%） | | 125.16% |

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。