

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 年第一季度	
		折算前数值	折算后数值
<b>合格优质流动性资产</b>			4,374,152
1	合格优质流动性资产		
<b>现金流出</b>			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	9,262,853	923,511
3	稳定存款	43,202	1,546
4	欠稳定存款	9,219,651	921,965
5	无抵（质）押批发融资，其中：	10,272,581	3,554,165
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	5,668,710	1,374,010
7	非业务关系存款（所有交易对手）	4,555,524	2,131,808
8	无抵（质）押债务	48,347	48,347
9	抵（质）押融资		23,173
10	其他项目，其中：	3,481,174	1,442,907
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	1,257,746	1,257,746
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	2,223,428	185,161
14	其他契约性融资义务	45,607	45,420
15	或有融资义务	1,038,511	24,236
16	<b>预期现金流出总量</b>		6,013,412
<b>现金流入</b>			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	466,977	205,863
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,350,134	931,964
19	其他现金流入	1,266,878	1,260,670
20	<b>预期现金流入总量</b>	3,083,989	2,398,497
			调整后数值
21	<b>合格优质流动性资产</b>		4,374,152
22	<b>现金净流出量</b>		3,614,915
23	<b>流动性覆盖率</b>		121.33%

注：上表中各项数据均为最近一个季度内 90 个自然日数值的简单算术平均值。