

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		2018 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>			
1	合格优质流动性资产		4,865,333
<b>现金流出</b>			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	9,558,276	952,696
3	稳定存款	49,065	1,775
4	欠稳定存款	9,509,211	950,921
5	无抵（质）押批发融资，其中：	11,115,784	3,791,180
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	6,184,075	1,499,016
7	非业务关系存款（所有交易对手）	4,873,148	2,233,603
8	无抵（质）押债务	58,561	58,561
9	抵（质）押融资		46,973
10	其他项目，其中：	4,062,549	1,441,005
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	1,206,858	1,206,858
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	2,855,691	234,147
14	其他契约性融资义务	50,158	49,846
15	或有融资义务	2,228,674	85,002
16	<b>预期现金流出总量</b>		<b>6,366,702</b>
<b>现金流入</b>			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	848,857	267,318
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,233,605	820,435
19	其他现金流入	1,225,098	1,216,755
20	<b>预期现金流入总量</b>	<b>3,307,560</b>	<b>2,304,508</b>
			调整后数值
21	<b>合格优质流动性资产</b>		<b>4,865,333</b>
22	<b>现金净流出量</b>		<b>4,062,194</b>
23	<b>流动性覆盖率（%）</b>		<b>120.57%</b>

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。