

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		2019年第三季度	
		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		4,986,360
<b>现金流出</b>			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	10,990,820	1,095,045
3	稳定存款	62,122	2,175
4	欠稳定存款	10,928,698	1,092,870
5	无抵（质）押批发融资，其中：	12,880,037	4,290,560
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	7,331,602	1,779,172
7	非业务关系存款（所有交易对手）	5,461,268	2,424,221
8	无抵（质）押债务	87,167	87,167
9	抵（质）押融资		18,291
10	其他项目，其中：	3,424,206	1,217,514
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	1,028,791	1,028,786
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	2,395,415	188,728
14	其他契约性融资义务	57,535	57,008
15	或有融资义务	3,589,331	116,291
16	<b>预期现金流出总量</b>		<b>6,794,709</b>
<b>现金流入</b>			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	1,018,439	539,828
18	完全正常履约付款带来的现金流入	1,508,784	1,111,680
19	其他现金流入	1,033,318	1,026,455
20	<b>预期现金流入总量</b>	<b>3,560,541</b>	<b>2,677,963</b>
			调整后数值
21	<b>合格优质流动性资产</b>		<b>4,986,360</b>
22	<b>现金净流出量</b>		<b>4,116,746</b>
23	<b>流动性覆盖率（%）</b>		<b>121.18%</b>

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。