

本行根据《商业银行流动性覆盖率信息披露办法》相关规定披露流动性覆盖率信息。本行2016年第一季度流动性覆盖率月度均值为106.92%，第一季度内三个月末各明细项目的平均值如下表所示：

(单位：人民币百万元)

序号		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		646,414
<b>现金流出</b>			
2	零售存款、小企业客户存款，其中：	1,394,837	139,392
3	稳定存款	1,828	91
4	欠稳定存款	1,393,009	139,301
5	无抵（质）押批发融资，其中：	2,456,090	1,147,956
6	业务关系存款（不包括代理行业务）	1,007,860	250,335
7	非业务关系存款（所有交易对手）	1,446,194	895,586
8	无抵（质）押债务	2,036	2,036
9	抵（质）押融资		37,916
10	其他项目，其中：	470,255	50,958
11	与衍生产品及其他抵（质）押品要求相关的现金流出	26,221	26,011
12	与抵（质）押债务工具融资流失相关的现金流出	132	132
13	信用便利和流动性便利	443,902	24,815
14	其他契约性融资义务	41,198	41,198
15	或有融资义务	873,822	17,452
16	<b>预期现金流出总量</b>		<b>1,434,873</b>
<b>现金流入</b>			
17	抵（质）押借贷（包括逆回购和借入证券）	214,797	214,797
18	完全正常履约付款带来的现金流入	995,003	588,757
19	其他现金流入	28,473	27,738
20	<b>预期现金流入总量</b>	<b>1,238,273</b>	<b>831,292</b>
			调整后数值
21	<b>合格优质流动性资产</b>		<b>646,414</b>
22	<b>现金净流出量</b>		<b>603,581</b>
23	<b>流动性覆盖率（%）</b>		<b>106.92%</b>

注：数据为集团并表口径，季度内各月末数值的算术平均值。