

北京农村商业银行股份有限公司

2020 年二季度末流动性风险监管指标情况

按照银保监会《商业银行流动性风险管理办法》（中国银行保险监督管理委员会令〔2018〕第3号）及其他相关规定的要求，本行流动性覆盖率和净稳定资金比例两项监管指标披露如下：

北京农商银行流动性风险监管指标情况表

单位：人民币万元

项目	2020 年二季度末	2020 年一季度末
1. 流动性覆盖率	208.27%	128.74%
合格优质流动性资产	15,638,509.24	11,772,854.92
未来 30 天现金净流出量	7,508,714.64	9,144,967.07
2. 净稳定资金比例	146.77%	141.23%
可用的稳定资金	59,231,449.10	58,278,257.79
所需的稳定资金	40,357,853.99	41,264,049.12

注：1. 由于本行无控股子公司，因此目前流动性风险管理指标只计算本行数。

2. 流动性覆盖率=合格优质流动性资产/未来 30 天现金净流出量。

3. 净稳定资金比例=可用的稳定资金/ 所需的稳定资金。