

北京农村商业银行股份有限公司
2020 年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 年末	2020 年三季度末
1. 流动性覆盖率	173.41%	149.86%
合格优质流动性资产	17,911,517.98	18,337,721.48
未来 30 天现金净流出量	10,328,817.99	12,236,576.63
2. 净稳定资金比例	149.17%	145.75%
可用的稳定资金	61,935,330.90	59,678,504.82
所需的稳定资金	41,519,030.45	40,946,726.70

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。