

北京农村商业银行股份有限公司
2021 年上半年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情况如下：

北京农商银行流动性风险监管指标情况表 单位：人民币千元

项目	2021年6月30日	2021年3月31日
1. 流动性覆盖率	152.56%	117.61%
合格优质流动性资产	134,081,109	148,447,080
未来30天现金净流出量	87,887,149	126,218,041
2. 净稳定资金比例	147.64%	142.68%
可用的稳定资金	616,908,549	616,350,751
所需的稳定资金	417,842,414	431,994,408

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。

4. 两项监管指标均未经审计。