

北京农村商业银行股份有限公司
2023 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	2023 年 6 月 30 日	2023 年 3 月 31 日
1. 流动性覆盖率	143.43%	115.34%
合格优质流动性资产	227,749,984	264,615,896
未来 30 天现金净流出量	158,791,262	229,428,067
2. 净稳定资金比例	146.66%	146.45%
可用的稳定资金	732,464,142	726,335,516
所需的稳定资金	499,430,268	495,969,423

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。