

## G25 第I部分 流动性覆盖率

填报机构:

报表日期: 2018 年 12月 日

### 第I部分: 流动性覆盖率

序号	项目	A	B
		金额	折算率
I. 基础数据			
1	1.合格优质流动性资产		
2	1.1一级资产	#VALUE!	
3	1.1.1现金	朱张婷：现金_C	100%
4	1.1.2压力条件下可动用的央行准备金		100%
5	1.1.3风险权重为零的证券	0.00	
6	1.1.3.1主权国家发行的	朱张婷：证券+陆轶凡：证券+陆轶凡：现金*陆轶凡：国债*吴玉姝：股票_D	100%
7	1.1.3.2主权国家担保的	(朱张婷：证券+陆轶凡：证券)*吴玉姝：	100%
8	1.1.3.3央行发行或担保的		100%
9	1.1.3.4其他机构发行或担保的		100%
10	1.1.4 母国或流动性风险所在国权重不为0%时，上述国家主权或央行发行的本币债券		100%
11	1.1.5 母国或流动性风险所在国权重不为0%时，上述国家主权或央行发行的外币债券		100%
12	1.2二级资产	0.00	
13	1.2.1 2A资产-公司债券		85%
14	1.2.2 2A资产-担保债券	朱张婷：证券+(陆轶凡：现金-吴玉姝：国债)/陆轶凡：证券_B	85%
15	1.2.3 2A资产-风险权重为20%的证券		
16	1.2.3.1主权国家发行的		85%
17	1.2.3.2主权国家担保的		85%
18	1.2.3.3央行发行或担保的		85%
19	1.2.3.4公共部门实体发行或担保的		85%
20	1.2.3.5其他机构发行或担保的		85%
21	1.2.4 2B资产-公司债券		50%
22	2.净现金流出		
23	2.1 现金流出		
24	2.1.1零售存款的现金流出		
25	2.1.1.1稳定存款（满足有效存款保险附加标准）		3%
26	2.1.1.2稳定存款（不满足有效存款保险附加标准）		5%
27	2.1.1.3欠稳定存款（有存款保险）		10%
28	2.1.1.4欠稳定存款（无存款保险）		10%
29	2.1.2无担保批发现金流出		
30	2.1.2.1小企业		
31	2.1.2.1.1稳定存款（满足有效存款保险附加标准）		5%
32	2.1.2.1.2稳定存款（不满足有效存款保险附加标准）		10%
33	2.1.2.1.3欠稳定存款（有存款保险）		10%
34	2.1.2.1.4欠稳定存款（无存款保险）		10%
35	2.1.2.2大中型企业		
36	2.1.2.2.1有业务关系且有存款保险（满足有效存款保险附加标准）		3%
37	2.1.2.2.2有业务关系且有存款保险（不满足有效存款保险附加标准）		5%

38	2.1.2.2.3有业务关系且无存款保险		25%
39	2.1.2.2.4无业务关系且有存款保险		20%
40	2.1.2.2.5无业务关系且无存款保险		40%
41	2.1.2.3主权国家、央行、公共部门实体和多边开发银行		
42	2.1.2.3.1有业务关系且有存款保险（满足有效存款保险附加标准）		3%
43	2.1.2.3.2有业务关系且有存款保险（不满足有效存款保险附加标准）		5%
44	2.1.2.3.3有业务关系且无存款保险		25%
45	2.1.2.3.4无业务关系且有存款保险		20%
46	2.1.2.3.5无业务关系且无存款保险		40%
47	2.1.2.4金融机构		
48	2.1.2.4.1银行存款，有业务关系且有存款保险（满足有效存款保险附加标准）		3%
49	2.1.2.4.2银行存款，有业务关系且有存款保险（不满足有效存款保险附加标准）		5%
50	2.1.2.4.3银行存款，有业务关系且无存款保险	249.01	25%
51	2.1.2.4.4其他金融机构存款，有业务关系且有存款保险（满足有效存款保险附加标准）		3%
52	2.1.2.4.5其他金融机构存款，有业务关系且有存款保险（不满足有效存款保险附加标准）		5%
53	2.1.2.4.6其他金融机构存款，有业务关系且无存款保险		25%
54	2.1.2.4.7无托管、清算及现金管理目的，合作银行网络中其他银行的存款		25%
55	2.1.2.4.8无业务关系的金融机构存款	361,003.77	100%
56	2.1.2.5未包含在以上无担保批发现金流出分类的其他类别		100%
57	2.1.2.6填报机构发行的30天内到期债务		100%
58	<b>2.1.3担保融资流出</b>		
59	2.1.3.1与央行进行的担保融资		0%
60	2.1.3.1.1 其中，以合格优质流动性资产为押品的融资		
61	2.1.3.1.1.1 一级资产押品市值		
62	2.1.3.1.1.2 2A资产押品市值		
63	2.1.3.1.1.3 2B资产押品市值		
64	2.1.3.2由一级资产担保的融资交易（与央行以外其他交易对手）		0%
65	2.1.3.2.1 押品市场价值		
66	2.1.3.3由2A级资产担保的融资交易（与央行以外其他交易对手）		15%
67	2.1.3.3.1押品市场价值		
68	2.1.3.4由2B级资产担保的融资交易（与央行以外其他交易对手）		
69	2.1.3.4.1交易对手为本国主权、多边开发银行、公共部门实体		25%
70	2.1.3.4.1.1押品市场价值		
71	2.1.3.4.2其他交易对手		50%
72	2.1.3.4.2.1押品市场价值		
73	2.1.3.5由其他资产担保的融资交易（与央行以外其他交易对手）		
74	2.1.3.5.1交易对手为本国主权、多边开发银行、公共部门实体		25%
75	2.1.3.5.2其他交易对手		100%
76	<b>2.1.4其他项目</b>		

77	2.1.4.1衍生产品交易的净现金流出	18,627.08	100%
78	2.1.4.2融资交易、衍生产品等合约中包含 降级触发条款导致的流动性补充需求		100%
79	2.1.4.3衍生产品及其他交易中非一级资产 押品估值变化导致的流动性补充需求		20%
80	2.1.4.4衍生产品及其他交易市值变动导致 的流动性补充需求		100%
81	2.1.4.5超额非隔离押品被收回导致的流动 性补充需求		100%
82	充需求		100%
83	2.1.4.7合格优质流动性资产押品替换导致 的流动性补充需求		100%
84	2.1.4.8资产支持证券、担保债券等结构性 融资工具		100%
85	2.1.4.9资产支持商业票据、管道工具、证 券投资载体和类似融资工具		
86	2.1.4.9.1 30天内到期债务		100%
87	2.1.4.9.2 30天以上或无到期日但均内含 期权的债务		100%
88	2.1.4.10未提取的不可无条件撤销的信用 便利和流动性便利		
89	2.1.4.10.1零售客户和小企业		5%
90	2.1.4.10.2大中型企业		
91	2.1.4.10.2.1信用便利		10%
92	2.1.4.10.2.2流动性便利		30%
93	2.1.4.10.3主权国家、央行、公共部门实 体和多边开发银行		
94	2.1.4.10.3.1信用便利		10%
95	2.1.4.10.3.2流动性便利		30%
96	2.1.4.10.4银行		
97	2.1.4.10.4.1信用便利		40%
98	2.1.4.10.4.2流动性便利		40%
99	2.1.4.10.5其他金融机构		
100	2.1.4.10.5.1信用便利		40%
101	2.1.4.10.5.2流动性便利		100%
102	2.1.4.10.6其他法人客户以及管道工具、 特殊目的载体等		
103	2.1.4.10.6.1信用便利		100%
104	2.1.4.10.6.2流动性便利		100%
105	2.1.4.11其他30日内放款的契约性义务		
106	2.1.4.11.1金融机构		100%
107	2.1.4.11.2其他客户		
108	<b>2.1.5其他或有融资义务</b>		
109	2.1.5.1无条件可撤销的信用及流动性便利		0%
110	2.1.5.2保函		2.5%
111	2.1.5.3信用证		2.5%
112	2.1.5.4其他贸易融资工具		2.5%
113	2.1.5.5非契约性义务		2.5%
114	2.1.5.5.1其中：属于理财产品的部分		
115	2.1.5.6拥有附属交易商或做市商的发行机 构未偿付的超过30天的债券		2.5%
116	2.1.5.7以其他客户押品覆盖客户空头头寸 所导致的非契约性负债		50%
117	<b>2.1.6 其他所有没有包含在以上类别中的本 金、利息等现金流出</b>	1,216.58	100%
118	<b>2.2现金流入</b>		

119	<b>2.2.1 逆回购与证券借入</b>		
120	2.2.1.1押品未用于再抵押（买断式）		
121	2.2.1.1.1以一级资产为担保		0%
122	2.2.1.1.1.1押品市场价值		
123	2.2.1.1.2以2A资产为担保		15%
124	2.2.1.1.2.1押品市场价值		
125	2.2.1.1.3以2B资产为担保		50%
126	2.2.1.1.3.1押品市场价值		
127	贷款		50%
128	2.2.1.1.5其他		100%
129	2.2.1.2押品未用于再抵押（质押式）		100%
130	2.2.1.3押品用于再抵押		0%
131	<b>2.2.2完全正常履约的协议性现金流入</b>		
132	2.2.2.1零售客户		50%
133	2.2.2.2小企业		50%
134	2.2.2.3大中型企业		50%
135	门		50%
136	2.2.2.5中央银行		100%
137	2.2.2.6金融机构		
138	2.2.2.6.1有业务关系的款项		0%
139	2.2.2.6.2无业务关系，存放在合作网络中央机构的款项		0%
140	2.2.2.6.3其他借款和现金流入	313,736.92	100%
141	2.2.2.7 到期证券投资		100%
142	<b>2.2.3其他现金流入</b>		
143	2.2.3.1衍生产品交易的净现金流入	18,633.93	100%
144	2.2.3.2其他现金流入		50%
<b>II. 汇总计算</b>			
1	<b>1.合格优质流动性资产（汇总计算）</b>	0	
2	1.1一级资产（汇总计算）	0	
3	1.2 2A资产（汇总计算）	0	
4	1.3 2B资产（汇总计算）	0	
5	<b>2.净现金流出（汇总计算）</b>	95227	
6	2.1现金流出（汇总计算）	380910	
7	2.1.1零售存款的现金流出（汇	0	
8	2.1.2无担保批发现金流出（汇	361066	
9	2.1.3担保融资流出（汇总计算	0	
10	2.1.4其他项目（汇总计算）	18627	
11	2.1.5其他或有融资义务（汇总	0	
12	2.1.6其他所有没有包含在以上	1217	
13	2.2现金流入（汇总计算）	332371	
14	2.2.1逆回购与证券借入（汇总	0	
15	2.2.2完全正常履约的协议性现	313737	
16	2.2.3其他现金流入（汇总计算	18634	

17	3.流动性覆盖率	0.00%
----	----------	-------

III. 附注项目：

项目	A	B
1.押品互换还原后对合格优质流动性资产的影响	增加	减少
1.1对一级资产的影响		
1.2对2A资产的影响		
1.3对2B资产的影响		

项目	A	B
2. 30日内到期的担保融资和押品互换交易还原后对合格优质流动性资产的影响	金额	折算率
2.1对一级资产的影响	0	100%
2.2调整后一级资产	0	100%
2.3对2A资产的影响	0	85%
2.4调整后2A资产	0	85%
2.5对2B资产的影响	0	50%
2.6调整后2B资产	0	50%
2.7上限计算调整项		
2.7.1 2B资产调整项		
2.7.2 二级资产调整项		

填表人：

复核人：

版本号:1410

蓝色底为含公式区域

无数据部分

货币单位：万元

C	修订说明	与原报表 项目的关 联	
折算后 金额			
	修改项目名	保留	
		保留	
0		保留	G01: 1.现金
0		保留	G01-V: 1.1超额准备金存款
		保留	资金部
0		保留	【国债】可用市值
0		保留	【政策性金融债、资产管理公司债、汇金债、地方政府债】可用市值
0		保留	【央票】可用市值
0		保留	【BIS、IMF、欧洲央行、欧盟、多边开发银行债】可用市值
0	修改项目名	保留	
0	修改项目 名称（后 续修改）	保留	
		保留	
0		保留	【AA-以上CP、MTN、企业债】可用市值
0		保留	
		保留	
0		保留	
0		保留	
0	新增		铁道债
0	修改编号	1.2.3.4	
0	新增		
	删除2.1.1.1	保留	
0	新增		0
0	修改项目名	2.1.1.1.1	0
0	修改项目名	2.1.1.1.2	0
0	修改项目名称		G01-III个人活期+G01-III个人通知存款+Focus储蓄定期一个月以内（
		保留	
	修改填报说	保留	
0	新增		公金部
0	修改项目名	2.1.2.1.1	
0	修改项目名	2.1.2.1.2	
0	修改项目名	2.1.2.1.3	科技部模板
		保留	
0	新增		
0	修改项目名	2.1.2.2.2	

0	修改项目编 2.1.2.2.1	科技部模板	
0	新增		
0	修改系数 2.1.2.2.3		
	2.1.2.4	同业部+资金部+贸金部	
0	新增	0	
0	修改项目名 2.1.2.4.2	0	
0	修改项目编 2.1.2.4.1		
0	新增	0	
0	修改系数 2.1.2.4.3		
	2.1.2.3		
0	新增	0	
0	新增	0	
62	修改项目编 2.1.2.3.1	同业部+贸金部	
0	新增	0	
0	新增	0	
0	修改项目编 2.1.2.3.2		
	修改项目编 2.1.2.3.3		
361004	修改项目编 2.1.2.3.4	同业部+资金部,并表时需要减去村行活期和一个月以内到期定期	
0	保留	资金部	
0	保留	到期债券	
	保留	资金部	
0	新增		
	新增		
	新增		
	新增		
	新增		
0	修改项目名 2.1.3.1	461392.98	
	修改项目编 2.1.3.1.1		
0	修改项目名 2.1.3.2		
	修改项目编 2.1.3.2.1		
	新增		
0	新增		
	新增		
0	新增		
	新增		
	修改项目名 2.1.3.3		
0	修改项目编 保留		
0	修改项目编 保留		
	修改项目 名称, 封 保留 闭单元格		

18627	项目名称	保留	资金部(暂无)、贸金部
0	项目名称	保留	资金部、贸金部
0	项目名称	2.1.4.3.2	资金部、贸金部
0	项目名称、	2.1.4.7	资金部、贸金部
0	新增		
0	新增		
0	新增		
0	修改项目编	2.1.4.4	
	项目名称	2.1.4.5	
0		2.1.4.5.1	
0		2.1.4.5.2	
	项目名称	2.1.4.6	
0		2.1.4.6.1	风管部+信用卡未使用额度
		2.1.4.6.2	
0	填报说明:	2.1.4.6.2.1	
0	修改系数	2.1.4.6.2.1	
		2.1.4.6.3	
0		2.1.4.6.3.1	
0	修改系数	2.1.4.6.3.2	
	新增	删除原2.1.4	资金部
0	新增		
0	新增		未使用的村镇银行流动性支持额度
	新增		
0	新增		
0	新增		
	新增		
0	新增		
0	新增		
	项目名称		
0	新增		
0	新增		风管部
	保留		
0	保留		
0	保留		30天内到期保函的敞口金额
0	保留		30天内到期信用证的敞口金额
0	保留		海外待付
0	填报说明	保留	资金部
	保留		
0	项目名称	保留	
0	新增		
1217		保留	一个月内定期存款应付利息：现金流分析组结构/利息收入分析时间
		保留	



[illegible]

保留

新增  
新增  
新增  
新增  
新增

C
折算后金额
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00
0.00

新增  
新增  
新增  
新增  
新增  
新增  
新增  
新增  
新增  
新增

负责人：

I

现金流分析组结构/现金流时间窗口/Principal/2.5.2.2)



