

关于外资银行流动性风险相关指标的说明

一、外商独资银行、中外合资银行集团内跨境资金净流出比例

集团内跨境资金净流出比例为外商独资银行、中外合资银行与境外集团内机构交易的资产方净额与资本净额之比。

与境外集团内机构交易的资产方净额=存放境外集团内机构+拆放境外集团内机构+与境外集团内机构交易形成的其他资产余额—境外集团内机构存放—境外集团内机构拆放—与境外集团内机构交易形成的其他负债余额。

二、外国银行分行跨境资金净流出比例

跨境资金净流出比例为外国银行分行与境外机构交易的资产方净额与营运资金净额之比。

外国银行分行与境外机构交易的资产方净额=存放境外联行、附属机构及同业+拆放境外联行、附属机构及同业+与境外联行、附属机构及同业交易形成的其他资产余额—境外联行、附属机构及同业存放—境外联行、附属机构及同业拆放—与境外联行、附属机构及同业交易形成的其他负债余额。

营运资金净额=营运资金余额+未分配利润—贷款损失准备尚未提足的部分。