

中國建設銀行股份有限公司
香港分行

監管披露

2020年9月30日

(未經審計)

中國建設銀行股份有限公司 - 香港分行
 財務資料披露聲明書
 截至二零二零年九月三十日止三個月
 流動性覆蓋比率標準披露模版

(港幣千元)	季度結算至 2020年09月30日 (65個數據點)		季度結算至 2020年06月30日 (60個數據點)	
	(a)	(b)	(a)	(b)
	非加權值 (平均)	加權值 (平均)	非加權值(平 均)	加權值 (平均)
披露基礎：香港辦事處				
A. 優質流動資產				
1	優質流動資產(HQLA)總額	41,973,373		39,964,457
B. 現金流出				
2	零售存款及小型企業借款，其中：	-	-	-
3	穩定零售存款及穩定小型企業借款	-	-	-
4	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	-	-	-
4a	零售定期存款及小型企業定期借款	-	-	-
5	無抵押批發借款（小型企業借款除外）及認可機構發行的債務證券及訂明票據，其中：	72,734,139	53,265,965	85,103,480
6	營運存款	-	-	-
7	第6行未涵蓋的無抵押批發借款（小型企業借款除外）	71,484,880	52,016,706	79,721,176
8	由認可機構發行並可在LCR涵蓋時期內贖回的債務證券及訂明票據	1,249,259	1,249,259	5,382,304
9	有抵押借款交易（包括證券掉期交易）		31,515	-
10	額外規定，其中：	30,665,306	7,133,276	27,672,463
11	衍生工具合約及其他交易所產生的現金流出，以及相關抵押品規定所產生的額外流動性需要	666,640	666,640	449,903
12	因結構式金融交易下的義務及因付還從該等交易取得的借款而產生的現金流出	-	-	-
13	未提取的有承諾融通（包括有承諾信貸融通及有承諾流動性融通）的潛在提取	29,998,666	6,466,636	27,222,560
14	合約借出義務（B節未以其他方式涵蓋）及其他合約現金流出	1,419,212	1,419,212	3,045,043
15	其他或有出資義務（不論合約或非合約義務）	75,144,007	3,203,704	88,630,961
16	現金流出總額		65,053,672	70,226,927
C. 現金流入				
17	有抵押借出交易（包括證券掉期交易）	340,925	-	536,482
18	有抵押或無抵押貸款（第17行涵蓋的有抵押借出交易除外）及存於其他金融機構的營運存款	42,727,697	30,419,820	64,968,108
19	其他現金流入	26,125,049	3,069,831	19,136,056
20	現金流入總額	69,193,671	33,489,651	84,640,646
D. LCR (經調整價值)				
21	HQLA 總額		41,973,373	39,964,457
22	淨現金流出總額		31,564,021	21,183,998
23	LCR (%)		133.73%	198.13%

平均流動性覆蓋比率(LCR)是根據《銀行業(披露)規則》第103A條的要求作出披露。按香港金融管理局的監管要求，季度平均流動性覆蓋比率是根據季內每工作日末的流動性覆蓋比率的算術平均數計算。

中國建設銀行股份有限公司 - 香港分行
財務資料披露聲明書
截至二零二零年九月三十日止三個月
穩定資金淨額比率

披露基礎：香港辦事處 貨幣：港幣千元	季度結算至 2020 年 9 月 30 日	季度結算至 2020 年 6 月 30 日
可用穩定資金總額	117,345,007	125,199,851
所需穩定資金總額	101,396,621	106,673,309
NSFR (%)	115.73	117.37

穩定資金淨額比率(NSFR)是根據《銀行業(披露)規則》第 103AB 條的要求作出披露並於“認可機構穩定資金狀況申報表”內上報香港金融管理局。

穩定資金淨額比率是衡量分行的可用穩定資金(“ASF”)與分行所需的所需核心資金(“RSF”)之比。

ASF 是分行資產負債表內負債的加權金額之和。RSF 是分行的表內資產和表外債務的加權金額之和。

遵照《銀行業(披露)規則》規定，現披露本行披露報告。