

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
 截至二零一九年三月三十一日止三個月
 附錄：流動性覆蓋比率標準披露模版

為計算截至2018年12月31日及2019年3月31日止季度的流動性覆蓋比率 (LCR) 的平均值及本模版所列相關項目所用的數據點數目		季度結算至2019年3月31日 (數據點數目：60)		季度結算至2018年12月31日 (數據點數目：62)	
披露基礎：香港辦事處 貨幣：港幣千元		未加權數額 (平均值)	加權數額 (平均值)	未加權數額 (平均值)	加權數額 (平均值)
A. 優質流動資產					
1	優質流動資產 (HQLA) 總額		101,458,408		110,495,227
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) 及該機構發行的債務證券及訂明票據，其中：	89,726,709	63,228,083	100,885,197	67,320,363
6	營運存款	-	-	-	-
7	第7項未涵蓋的無抵押批發借款 (小型企業借款除外)	84,586,307	58,087,681	95,560,904	61,996,070
8	由該機構發行並可在該LCR涵蓋時期內贖回的債務證券及訂明票據	5,140,402	5,140,402	5,324,293	5,324,293
9	有抵押借款交易 (包括證券掉期交易)		-		134,045
10	額外規定，其中：	27,041,818	5,855,836	27,295,085	5,901,910
11	衍生工具合約或其他交易所產生的現金流出，及相關抵押品規定所產生的額外流動性需要	402,792	402,792	430,041	430,041
12	因結構式金融交易下的義務及因付還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	26,639,026	5,453,044	26,865,044	5,471,869
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	1,567,710	1,567,710	2,341,668	2,341,668
15	其他或有出資義務 (不論是合約或非合約義務)	104,518,570	3,177,137	106,560,400	3,014,166
16	現金流出總額		73,828,766		78,712,152
C. 現金流入					
17	有抵押借出交易 (包括證券掉期交易)	21,099	-	33,973	-
18	有抵押及無抵押貸款 (第18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	56,099,526	44,014,644	62,151,825	48,903,213
19	其他現金流入	22,418,932	1,508,320	16,441,428	3,657,506
20	現金流入總額	78,539,557	45,522,964	78,627,226	52,560,719
D. 流動性覆蓋比率		經調整價值		經調整價值	
21	HQLA總額		101,458,408		110,495,227
22	淨現金流出總額		28,305,802		26,738,355
23	LCR (%)		433.99%		477.77%

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
截至二零一九年三月三十一日止三個月
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2019年3月31日	季度結算至2018年12月31日
可用穩定資金總額	189,885,534	200,133,309
所需穩定資金總額	156,548,483	165,401,391
NSFR (%)	121.30	121.00