

流动性覆盖率标准披露模板<sup>a</sup>

为计算截至 9月30日 止季度的流动性覆盖率 (LCR) 的平均值及本模板所列相关项目所用的数据点数目: ( 77 )		货币: (港币)		于「流动性状况申报表」(MA(BS)1E)的对应项目
披露基础: 综合 / 非综合 / 香港办事处(删去不适用者)		未加权数额 (平均值)	加权数额 (平均值)	
<b>A. 优质流动资产</b>				
1	优质流动资产 (HQLA) 总额		54,848,207	第2(I)部A节第4项 (- 第6项, 如适用)
<b>B. 现金流出</b>				
2	零售存款及小型企业借款, 其中:	139,734,522	9,656,757	第2(I)部B节第 1 + 2 + 3 + 4 项
3	稳定零售存款及稳定小型企业借款	3,110,429	155,522	第2(I)部B节第 1(a) + 2(a) + 3(a) + 4(a) 分项
4	较不稳定零售存款及较不稳定小型企业借款	53,400,601	5,340,060	第2(I)部B节第 1(b) + 2(b) + 3(b) + 4(b) 分项
5	零售定期存款及小型企业定期借款	83,223,492	4,161,175	第2(I)部B节第 1(c) + 2(c) + 3(c) + 4(c) 分项
6	无抵押批发借款 (小型企业借款除外)及该机构发行的债务证券及订明票据, 其中:	141,941,975	105,670,924	第2(I)部B节第 5 + 6 + 7 项
7	营运存款	0	0	第2(I)部B节第 5(a) + 5(b) 分项
8	第7项未涵盖的无抵押批发借款 (小型企业借款除外)	140,407,679	104,136,628	第2(I)部B节第 6(a)(i) + 6(a)(ii) + 6(b) 分项
9	由该机构发行并可在该LCR涵盖时期内赎回的债务证券及订明票据	1,534,296	1,534,296	第2(I)部B节第 7 项
10	有抵押借款交易(包括证券掉期交易)		0	第2(I)部B节第 8 + 9项
11	额外规定, 其中:	17,769,978	2,907,503	第2(I)部B节第 10 至 19 项
12	衍生工具合约或其他交易所产生的现金流出, 及相关抵押品规定所产生的额外流动性需要	1,158,167	1,158,167	第2(I)部B节第10 + 11 + 12 + 13 + 14 + 15 + 16 项
13	因结构式金融交易下的义务及因付还该等交易取得的借款而产生的现金流出	0	0	第2(I)部B节第17 + 18 项
14	未提取的有承诺融通(包括有承诺信贷融通及有承诺流动性融通)的潜在提取	16,611,811	1,749,336	第2(I)部B节第 19 项
15	合约借出义务(B节未以其他方式涵盖)及其他合约现金流出	2,998,052	2,998,052	第2(I)部B节第 20 + 22 项
16	其他或有出资义务(不论是合约或非合约义务)	56,999,591	204,153	第2(I)部B节第 21 项
17	<b>现金流出总额</b>		<b>121,437,389</b>	Pa第2(I)部B节第 23 项
<b>C. 现金流入</b>				
18	有抵押借出交易(包括证券掉期交易)	0	0	第2(I)部C节第 1 + 2 + 3 项
19	有抵押及无抵押贷款(第18行涵盖的有抵押借出交易除外)及存于其他金融机构的营运存款	86,192,457	72,500,561	第2(I)部C节第 4 + 8项
20	其他现金流入	62,804,979	2,787,926	第2(I)部C节第 5 + 6 + 7 + 9 + 10 项
21	<b>现金流入总额</b>	<b>148,997,436</b>	<b>75,288,487</b>	第2(I)部C节第 11 项
<b>D. 流动性覆盖率</b>				
				经调整价值
22	HQLA总额		54,848,207	第2(I)部A节第 7 项
23	净现金流出总额		46,350,183	第2(I)部B节第 23 项 - 第2(I)部C节第 1 2项
24	<b>LCR (%)</b>		<b>118.68%</b>	第2(I)部D节

<sup>a</sup> This is the standard disclosure template that a category 1 institution must use for the purposes of making its liquidity information disclosures under section 30A, 51A or 103A (as applicable) of the Banking (Disclosure) Rules. Please refer to the accompanying Completion Instructions for instructions on the completion of this Template (including the manner in which individual disclosure items are to be calculated).