

杠杆比率通用披露模版

	项目	杠杆比率框架 等值港币千元
资产负债表内风险承担		
1	资产负债表内项目(不包括衍生工具及证券融资交易,但包括抵押品)	514,907,082
2	扣减:断定《巴塞尔协定三》一级资本时所扣减的资产数额(以负数表示)	(234,912)
3	资产负债表内风险承担总额(不包括衍生工具及证券融资交易)(第1及2行相加之数)	514,672,170
衍生工具风险承担		
4	所有与衍生工具交易有关的重置成本(即扣除合格现金变动保证金)	7,010,980
5	所有与衍生工具交易有关的潜在未来风险承担的附加数额	5,888,489
6	还原因提供予对手方而须根据适用会计框架从资产负债表中扣减的衍生工具抵押品的数额	0
7	扣减:就衍生工具交易提供的现金变动保证金的应收部分(以负数表示)	0
8	扣减:中央交易对手方风险承担中与客户结算交易有关而获豁免的部分(以负数表示)	0
9	经调整后已出售信用衍生工具的有效名义数额	0
10	扣减:就已出售信用衍生工具作出调整的有效名义抵销及附加数额的扣减(以负数表示)	0
11	衍生工具风险承担总额(第4至10行相加之数)	12,899,469
证券融资交易风险承担		
12	经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的证券融资交易资产总计	355,741
13	扣减:证券融资交易资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额(以负数表示)	0
14	证券融资交易资产的对对手方信用风险承担	0
15	代理交易风险承担	0
16	证券融资交易风险承担总额(第12至15行相加之数)	355,741
其他资产负债表外风险承担		
17	资产负债表外风险承担名义数额总计	85,281,062
18	扣减:就转换为信贷等值数额作出的调整(以负数表示)	(66,090,832)
19	资产负债表外项目(第17及18行相加之数)	19,190,230
资本及风险承担总额		
20	一级资本	56,438,098
21	风险承担总额(第3、11、16及19行相加之数)	547,117,610
杠杆比率		
22	《巴塞尔协定三》杠杆比率	10.32%

对帐摘要比较表

项目	杠杆比率框架 等值港币千元
1 已发布财务报表所刊载的综合资产总额	521,024,713
2 对为会计目的须作综合计算、但在监管综合计算范围以外的金融业实体或商业实体的投资而须作的相关调整	326,499
3 根据认可机构的适用会计框架于资产负债表内确认、但不包括在杠杆比率风险承担计量值内的任何受信资产而须作的相关调整	0
4 有关衍生金融工具的调整	6,111,132
5 有关证券融资交易的调整(即回购交易及其他类似的有抵押借贷)	0
6 有关资产负债表外项目的调整(即资产负债表外风险承担转换为信贷等值数额)	19,190,230
7 其他调整	465,036
8 杠杆比率风险承担	547,117,610