

# 中国建设银行(亚洲)股份有限公司

监管披露 2021年3月31日 (未经审计)

# 中国建设银行 (亚洲) 股份有限公司 监管披露

2021年3月31日

港币千元

#### KM1: 主要审慎比率

以下图表提供本银行的主要审慎比率,并根据金管局颁布的《银行业(资本)规则》和《银行业(流动性)规则》计算。

		(a)	(b)	(c)	(d)	(e)
		2021年	2020年	2020年	2020年	2020年
		3月31日	12月31日	9月30日	6月30日	3月31日
	监管资本 (数额)					
1	普通股权一级(CET1)	61,047,698	60,424,343	59,327,097	58,556,533	58,460,277
2	一级	76,637,031	76,013,676	74,916,430	74,145,866	74,049,767
3	总资本	79,584,550	78,781,662	77,885,764	77,240,808	77,478,885
	风险加权数额(数额)					
4	风险加权数额总额	382,405,184	367,422,557	387,137,371	404,494,230	404,456,109
	风险为本监管资本比率(以风险加权数额的百分	`率表示)				
5	CET1 比率 (%)	15.96%	16.45%	15.32%	14.48%	14.45%
6	一级比率 (%)	20.04%	20.69%	19.35%	18.33%	18.31%
7	总资本比率 (%)	20.81%	21.44%	20.12%	19.10%	19.16%
	额外 CET1 缓冲要求(以风险加权数额的百分率	表示)				
8	防护缓冲资本要求 (%)	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%	2.50%
9	逆周期缓冲资本要求 (%)	0.85%	0.83%	0.83%	0.83%	0.81%
10	较高吸收亏损能力要求 (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
	(只适用于 G-SIB 或 D-SIB)					
11	认可机构特定的总 CET1 缓冲要求 (%)	3.35%	3.33%	3.33%	3.33%	3.31%
12	符合认可机构的最低资本规定后可用的 CET1 (%)	11.46%	11.95%	10.82%	9.98%	9.95%
	《巴塞尔协定三》杠杆比率					
13	总杠杆比率(LR)风险承担计量	503,382,011	504,155,929	526,037,339	523,560,595	538,711,165
14	杠杆比率(LR) (%)	15.22%	15.08%	14.24%	14.16%	13.75%
	流动性覆盖比率(LCR) / 流动性维持比率(LMR)					
	只适用于第1类机构:					
15	优质流动资产(HQLA)总额	65,096,130	76,613,022	57,167,631	56,253,958	62,644,510
16	净现金流出总额	45,803,530	48,313,939	38,928,385	33,322,547	41,746,929
17	LCR (%)	143.75%	163.62%	148.90%	172.24%	150.83%
	只适用于第2类机构:					
17a	LMR (%)	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
	稳定资金净额比率(NSFR)/核心资金比率(CFR)					
	只适用于第1类机构:					
18	可用稳定资金总额	335,509,000	341,302,646	352,696,619	353,494,446	356,343,666
19	所需稳定资金总额	251,862,316	239,512,506	260,506,881	262,447,756	270,766,415
20	NSFR (%)	133.21%	142.50%	135.39%	134.69%	131.61%
	只适用于第 2A 类机构:					
20a	CFR (%)	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用

### 中国建设银行 (亚洲) 股份有限公司 监管披露 2021年3月31日

港币千元

#### OV1: 风险加权数额概覧

下表列示信贷风险、市场风险及营运风险的风险加权资产细目分析,概述各类风险的资本规定。最低资本规定指须就相关风险持有的资本额,按其风险加权金额乘以8%计算。

		(a)	(b)	(c)
		风险加权数额		最低资本规定
		2021年	2020年	2021 年
		3月31日	12月31日	3月31日
1	非证券化类别风险承担的信用风险	341,843,563	326,396,670	27,347,485
2	其中 STC 计算法	341,843,563	326,396,670	27,347,485
2a	其中 BSC 计算法	-	-	-
3	其中基础 IRB 计算法	-	-	-
4	其中监管分类准则计算法	-	-	-
5	其中高级 IRB 计算法	-	-	-
6	对手方违责风险及违责基金承担	808,058	771,974	64,644
7	其中 SA-CCR	N/A	N/A	N/A
7a	其中现行风险承担方法	808,056	771,972	64,644
8	其中 IMM(CCR)计算法	-	-	-
9	其中其他	2	2	-
10	CVA 风险	424,863	334,238	33,989
11	简单风险权重方法及内部模式方法下的银行帐内股 权状况	-	-	-
12	集体投资计划风险承担——LTA	N/A	N/A	N/A
13	集体投资计划风险承担——MBA	N/A	N/A	N/A
14	集体投资计划风险承担——FBA	N/A	N/A	N/A
14a	集体投资计划风险承担——混合使用计算法	N/A	N/A	N/A
15	交收风险	-	-	-
16	银行帐内的证券化类别风险承担	-	-	-
17	其中 SEC-IRBA	-	-	-
18	其中 SEC-ERBA	-	-	-
19	其中 SEC-SA	-	-	ı
19a	其中 SEC-FBA	-	-	-
20	市场风险	23,016,175	23,477,350	1,841,294
21	其中 STM 计算法	23,016,175	23,477,350	1,841,294
22	其中 IMM 计算法	-	-	-
23	交易帐与银行帐之间切换的风险承担的资本要求 (经修订市场风险框架生效前不适用)	N/A	N/A	N/A
24	业务操作风险	15,037,525	15,167,325	1,203,002
24a	官方实体集中风险	-	-	-
25	低于扣减门坎的数额(须计算 250%风险权重)	1,275,000	1,275,000	102,000
26	资本下限调整	-	-	-
26a	风险加权数额扣减	-	-	-
26b	其中不包括在二级资本内的一般银行业务风险	-	-	-
	监管储备及集体准备金的部分			
26c	其中不包括在二级资本内的土地及建筑物因价 值重估而产生的累积公平价值收益的部分	-	-	-
27	总计	382,405,184	367,422,557	30,592,414

2021 第一季内,风险加权资产总值增加 150 亿港元,主要由于非证券化类别信用风险加权资产增加所至。

# 中国建设银行 (亚洲) 股份有限公司 监管披露 2021年3月31日

港币千元

#### LR2: 杠杆比率

送产负债表内风险承担         2021 年 3月31 日         2020 年 12月31 日           资产负债表内风险承担         (不包括由衍生工具合约或证券融资 交易(SFT)产生的风险承担、但包括抵押品)         477,230,320         475,694,593           2 加減、断定一级资本时所和减的资产数额         (1,013,247)         (424,473)           3 资产负债表内风险承担总额(不包括衍生工具合约及 SFT)         476,217,073         475,270,120           由衍生工具合约产生的风险承担         (424,473)         476,217,073         475,270,120           由衍生工具合约产性的风险承担         (76,217,073         475,270,120         476,217,073         475,270,120           由荷生工具合约产性的风险承担         (76,217,073         475,270,120         476,217,073         475,270,120           由荷生工具合约产生的风险承担         (76,217,073         475,270,120         476,217,073         475,270,120           由荷生工具合约产生的风险承担         (364,335         954,837         954,837           5 所有与衍生工具合约有关的需置成本、(如适用的活、扣除合 3.86,135         954,837         954,837           6 五原因提供分析可能工具合约有类型、(200,740)         (216,725)         (220,849)           7 扣滅、統行生工具合约建供的现金变动保证金的应收部分         (216,725)         (220,849)           9 经现金后间的部分         (216,725)         (220,849)           10 扣滅、致亡出告信用衍生工具合约作生工具合约作出调整的有效名义数额	LIXZ.	<u>                                     </u>	(-)	/1- \		
数产負債表内风险承担         12月31日           1         資产負債表内风险承担(不包括由衍生工具合约或证券融资			(a)	(b)		
1 一			-	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		
交易(SFT)产生的风险承担、但包括抵押品)	资产负	债表内风险承担				
3       資产负债表内风险承担息額(不包括衍生工具合约及 SFT)       476,217,073       475,270,120         由符生工具合约产生的风险承担       新有与衍生工具合约有关的重置成本(加适用的话,扣除合资格观金变动保证金及/或双边净额结算)       816,135       954,837         5       所有与衍生工具合约有关的潜在未来风险承担的附加数额       1,731,904       1,135,370         6       还原因提供子对手方而领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       -       -         7       扣减: 就曾生工具合约提供的现金变动保证金的应收部分 (216,725) (220,849)         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 第免的部分 - 据统的部分 - 报线的部分 - 报线的部分 - 报线的部分 - 报线的部分 - 报线的部分 - 不成别数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别如数额的相减 - 不成别处于产生的风险承担       -         10       扣减: 就已由售信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销 - 不成别处于产生的风险承担       2,331,314       1,869,358         11       衍生工具合约产生的风险承担总额	1		477,230,320	475,694,593		
由衍生工具合约产生的风险承担         816,135         954,837           5         所有与衍生工具合约有关的重置成本(如适用的话,扣除合 资格现金变动保证金及/或双边净额结算)         1,731,904         1,135,370           6         还原因提供予对手方而项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         1,731,904         1,135,370           7         扣減: 就衍生工具合约提供的现金变动保证金的应收部分         (216,725)         (220,849)           8         扣減: 中央交易对手方风险承担中与客户结算交易有关而获	2	扣减: 断定一级资本时所扣减的资产数额	(1,013,247)	(424,473)		
4       所有与衍生工具合约有关的重置成本(如适用的话、扣除合 资格现金变动保证金及 / 或双边净额结算)       816,135       954,837 资格现金变动保证金及 / 或双边净额结算)         5       所有与衍生工具合约有关的潜在未来风险承担的附加数额       1,731,904       1,135,370         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 扣减的衍生工具机押品的数额       -       -         7       扣减: 就衍生工具合约提供的观金变动保证金的应收部分       (216,725)       (220,849)         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 密免的部分       -       -         9       经调整后己出售信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销 无限的事效       -       -         10       扣减: 就已出售信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销 无限的有效名义抵销 无限的重要 2,331,314       1,869,358         11       衍生工具合约产生的风险承担总额       2,331,314       1,869,358         由 SFT产生的风险承担       -       -         12       经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 资产 资产的产业 388,483       346,009         13       扣减: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额       -       -         14       SFT 资产的对于方信用风险承担       -       -         15       代理交易风险承担       -       -         16       由 SFT产生的风险承担       -       -         17       资产负债表外风险承担       -       -         16       由 SFT产生的风险承担名义数额总额       107,014,016       106,052,960         18       和减。就转换为信贷等值数额作出的调整       (79,035,276)       (76,099,201)         19	3	资产负债表内风险承担总额(不包括衍生工具合约及 SFT)	476,217,073	475,270,120		
	由衍生	工具合约产生的风险承担				
6	4		816,135	954,837		
加減に就行生工具抵押品的数額	5	所有与衍生工具合约有关的潜在未来风险承担的附加数额	1,731,904	1,135,370		
8 扣滅: 中央交易对手方风险承担中与客户结算交易有关而获	6		-	-		
8 经调整后已出售信用衍生工具合约的有效名义数额       -       -         10 扣減: 就已出售信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销及附加数额的扣減       -       -         11 衍生工具合约产生的风险承担总额       2,331,314       1,869,358         由 SFT产生的风险承担       -       388,483       346,009         12 经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 388,483       346,009         13 扣减: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额       -       -         14 SFT 资产的对手方信用风险承担       -       -         15 代理交易风险承担       -       -         16 由 SFT 产生的风险承担总额       388,483       346,009         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额       107,014,016       106,052,960         18 扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整       (79,035,276)       (76,099,201)         19 资产负债表外项目       27,978,740       29,953,759         资本及风险承担总额       27,978,740       29,953,759         资本及风险承担总额       76,637,031       76,013,676         20 一级资本       76,637,031       76,013,676         20a 为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b 为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         红杆比率	7	扣减: 就衍生工具合约提供的现金变动保证金的应收部分	(216,725)	(220,849)		
10 扣減: 就已出售信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销 2,331,314 1,869,358 由 SFT 产生的风险承担总额 2,331,314 1,869,358 由 SFT 产生的风险承担 2 经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 388,483 346,009 总计 13 扣减: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额	8		-	-		
及附加数额的扣减 11 衍生工具合约产生的风险承担总额 2,331,314 1,869,358 由 SFT 产生的风险承担 12 经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 388,483 346,009 总计 13 扣减: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额 14 SFT 资产的对手方信用风险承担 15 代理交易风险承担 16 由 SFT 产生的风险承担总额 388,483 346,009 其他资产负债表外风险承担总额 388,483 346,009 其他资产负债表外风险承担自额 107,014,016 106,052,960 18 扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整 (79,035,276) (76,099,201) 19 资产负债表外项目 27,978,740 29,953,759 资本及风险承担总额 76,637,031 76,013,676 20a 为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额 506,915,610 507,439,246 20b 为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额 (3,533,599) (3,283,317) 21 为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额 503,382,011 504,155,929	9	经调整后已出售信用衍生工具合约的有效名义数额	-	-		
由 SFT 产生的风险承担  12 经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 388,483 346,009  13 扣滅: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额	10		-	-		
12 经销售会计交易调整后(在不确认净额计算下)的 SFT 资产 388,483 346,009	11	衍生工具合约产生的风险承担总额	2,331,314	1,869,358		
总计 13 扣減: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额	由 SFT	产生的风险承担				
14       SFT 资产的对手方信用风险承担       -       -         15       代理交易风险承担       -       -         16       由 SFT 产生的风险承担总额       388,483       346,009         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额       107,014,016       106,052,960         18       扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整       (79,035,276)       (76,099,201)         19       资产负债表外项目       27,978,740       29,953,759         资本及风险承担总额       -       20       -级资本       76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	12		388,483	346,009		
15 代理交易风险承担	13	扣减: SFT 资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额	-	-		
16 由 SFT 产生的风险承担总额 388,483 346,009 <b>其他资产负债表外风险承担</b> 17 资产负债表外风险承担名义数额总额 107,014,016 106,052,960   18 扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整 (79,035,276) (76,099,201)   19 资产负债表外项目 27,978,740 29,953,759 <b>资本及风险承担总额</b> 20 一级资本 76,637,031 76,013,676   20a 为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额 506,915,610 507,439,246   20b 为特定准备金及集体准备金作出调整 (3,533,599) (3,283,317)   21 为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额 503,382,011 504,155,929 <b>杠杆比率</b>	14	SFT 资产的对手方信用风险承担	-	-		
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额107,014,016106,052,96018扣減: 就转换为信贷等值数额作出的调整(79,035,276)(76,099,201)19资产负债表外项目27,978,74029,953,759资本及风险承担总额20一级资本76,637,03176,013,67620a为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额506,915,610507,439,24620b为特定准备金及集体准备金作出的调整(3,533,599)(3,283,317)21为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额503,382,011504,155,929杠杆比率	15	代理交易风险承担	-	-		
17       资产负债表外风险承担名义数额总额       107,014,016       106,052,960         18       扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整       (79,035,276)       (76,099,201)         19       资产负债表外项目       27,978,740       29,953,759         资本及风险承担总额       76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	16	由SFT产生的风险承担总额	388,483	346,009		
18       扣減: 就转换为信贷等值数额作出的调整       (79,035,276)       (76,099,201)         19       资产负债表外项目       27,978,740       29,953,759         資本及风险承担总额       76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	其他资	产负债表外风险承担				
19       资产负债表外项目       27,978,740       29,953,759 <b>资本及风险承担总额</b> 76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	17	资产负债表外风险承担名义数额总额	107,014,016	106,052,960		
资本及风险承担总额         20       一级资本       76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	18	扣减: 就转换为信贷等值数额作出的调整	(79,035,276)	(76,099,201)		
20       一级资本       76,637,031       76,013,676         20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	19	资产负债表外项目	27,978,740	29,953,759		
20a       为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额       506,915,610       507,439,246         20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	资本及	资本及风险承担总额				
20b       为特定准备金及集体准备金作出的调整       (3,533,599)       (3,283,317)         21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	20	一级资本	76,637,031	76,013,676		
21       为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额       503,382,011       504,155,929         杠杆比率	20a	为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额	506,915,610	507,439,246		
杠杆比率	20b	为特定准备金及集体准备金作出的调整	(3,533,599)	(3,283,317)		
	21	为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额	503,382,011	504,155,929		
22 杠杆比率 15.22% 15.08%	杠杆比	率				
	22	杠杆比率	15.22%	15.08%		

杠杆比率风险承担计量减少港币 774 百万元,主要由于减少原到期日一年以上的其他承担, 但部分被投资证券及衍生工具合约增加有所抵销

中国建设银行(亚洲)股份有限公司 监管披露 2021年3月31日 港币壬元

#### LIQ1: 流动性覆盖比率(LCR) 一 第 1 类机构

按金管局的监管要求,季度平均流动性覆盖比率是根据季内每工作日末的流动性覆盖比率的算术平均数计算。 流动性覆盖比率是衡量流动资产覆盖 **30** 天内到期的净现金流出总额,其包括由资产负债表内和表外(包括或有融资义务)所引起的。

2021年第一季度本行的平均流动性覆盖比率保持健康水平。

本行的优质流动性资产主要由现金、中央银行结存及由主权、中央银行、内地政策性银行和非金融企业等发行或担保的高质量有价债务证券所组成。本行主要资金来源为零售及企业客户存款。此外,本行亦透过发行存款证、中期票据、和短期同业市场拆借等,获取额外批发融资。

本行客户存款主要以港币计值。为满足客户的贷款需求,本行将多余的港元资金转换为美元及其他货币,导致流动性覆盖比率中的部分货币错配。

在流动性覆盖比率的计算中,本行通过分币种流动性覆盖比率来控制及监测优质流动资产与净现金流出之间的货币错配,并根据法定要求和内部风险管理政策要求,对优质流动资产组成设置集中度上限和限额进行管理。

本行密切监测所有与客户承造的交易所交易及场外交易的衍生品风险敞口及其相应的对冲活动。根据衍生工具合约的市场状况,银行可能需要提供抵押品予交易对手。尽管如此,有关的风险敞口小,相关现金流出对于流动性覆盖比率的影响来说非常轻微。

本行的流动性管理独立于建行集团其他成员,同时亦未向任何建行集团成员提供任何流动性支持。然而,建行总行为本行提供强大的流动性支持,是本行资金来源的重要部分。

优质流动资产的组成项目为:

化灰流勾负产的组成项目为:	加权值 <b>(平均)</b> 季度结算至 2021年3月31日	
1级资产	59,190,024	
2A级资产	2,906,716	
2B级资产	2,999,390	
优质流动资产的加权数总额	65,096,130	

# 中国建设银行 (亚洲) 股份有限公司 监管披露 2021年3月31日

港币千元

# LIQ1: 流动性覆盖比率(LCR) — 第 1 类机构 (续)

下表呈示 LCR 及优质流动资产(HQLA)的详细数据,以及现金流出与流入的细目分类:

在计算本模版所载的流动性覆盖比率(LCR)及相关组成项目的平均值时所使		季度结算至 2021 年 3 月 31 日	
用的数据点数目: 73		(a)	(b)
披露基础:香港办事处		非加权值	加权值
1以路		(平均)	(平均)
A.	优质流动资产		
1	优质流动资产(HQLA)总额		65,096,130
В.	现金流出		
2	零售存款及小型企業借款,其中:	221,019,089	16,730,378
3	稳定零售存款及稳定小型企業借款	3,763,846	112,915
4	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	115,094,019	11,509,402
4a	零售定期存款及小型企業定期借款	102,161,224	5,108,061
5	無抵押批發借款(小型企业借款除外)及認可機構发行的債務證券及 訂明票據,其中:	119,402,516	66,509,797
6	营运存款	-	-
7	第6行未涵盖的无抵押批发借款(小型企业借款除外)	119,402,516	66,509,797
8	由认可机构发行并可在LCR 涵盖时期内赎回的债务证	-	-
	券及订明票据		
9	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		-
10	额外规定, 其中:	44,365,175	8,221,806
11	衍生工具合约及其他交易所产生的现金流出,以及相关 抵押品规定所产生的额外流动性需要	1,458,418	1,454,418
12	因结构式金融交易下的义务及因付还从该等交易取得的 借款而产生的现金流出	40,387	40,387
13	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	42,870,370	6,727,001
14	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	2,645,299	2,645,299
15	其他或有出资义务(不论合约或非合约义务)	184,631,603	622,269
16	现金流出总额	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	94,729,549
C.	现金流入		0 1,1 = 0,0 10
17	有抵押借出交易(包括证券掉期交易)	-	-
18	有抵押或无抵押贷款(第 <b>17</b> 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	103,800,250	44,810,026
19	其他现金流入	64,124,666	4,115,993
20	现金流入总额	167,924,916	48,926,019
<b>D</b> .	LCR (经调整价值)	101,324,310	40,320,013
21	HQLA 总额		65,096,130
22	净现金流出总额		45,803,530
23	LCR (%)		143.75%
20	LOTT (70)		1-10.10/0