



中國建設銀行(亞洲)股份有限公司

監管披露

截至2017年3月31日止季度

(未經審核)

中國建設銀行(亞洲)股份有限公司
監管披露
2017年03月31日
港幣千元

主要資本比率

以下披露乃根據《銀行業（披露）規則》作出。

資本充足比率

截至2017年3月31日，資本充足率按照《銀行業（資本）規則》編制。

| | <u>2017年03月31日</u> |
|------------|--------------------|
| 資本 | |
| 普通股權一級資本 | 46,562,316 |
| 一級資本 | 46,562,316 |
| 總資本 | 55,410,109 |
| 總風險加權資產 | 323,610,872 |
| 資本充足比率 | |
| 普通股權一級資本比率 | 14.39% |
| 一級資本比率 | 14.39% |
| 總資本比率 | 17.12% |

槓桿比率

截至2017年3月31日的槓桿率按照香港金融管理局發行的槓桿比率框架編制。

| | <u>2017年03月31日</u> |
|-----------|--------------------|
| 資本和風險承擔總額 | |
| 一級資本 | 46,562,316 |
| 風險承擔總額 | 491,173,870 |
| 槓桿比率 | 9.48% |

中國建設銀行(亞洲)股份有限公司
 監管披露
 2017年03月31日
 港幣千元

OV1: 風險加權數額概覽

下表載列信貸風險、市場風險及營運風險的風險加權資產細目分析，概述各類風險的資本規定。最低資本規定指須就相關風險持有的資本額，按其風險加權金額乘以8%計算。

| | | 風險加權數額 | | 最低資本規定 |
|-----|--|-------------|-------------|-------------|
| | | 2017年03月31日 | 2016年12月31日 | 2017年03月31日 |
| 1 | 非證券化類別風險承擔的信用風險 | 277,952,365 | 277,232,569 | 22,236,189 |
| 2 | 其中STC計算法 | 277,952,365 | 277,232,569 | 22,236,189 |
| 2a | 其中BSC計算法 | - | - | - |
| 3 | 其中IRB計算法 | - | - | - |
| 4 | 對手方信用風險 | 4,964,566 | 7,049,506 | 397,165 |
| 5 | 其中SA-CCR計算法 | - | - | - |
| 5a | 其中現行風險承擔方法 | 3,743,416 | 5,230,606 | 299,473 |
| 6 | 其中IMM(CCR)計算法 | - | - | - |
| 7 | 使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔 | - | - | - |
| 8 | 集體投資計劃風險承擔 – LTA | - | - | - |
| 9 | 集體投資計劃風險承擔 – MBA | - | - | - |
| 10 | 集體投資計劃風險承擔 – FBA | - | - | - |
| 11 | 交收風險 | - | - | - |
| 12 | 銀行帳內的證券化類別風險承擔 | - | - | - |
| 13 | 其中IRB(S)計算法 – 評級基準方法 | - | - | - |
| 14 | 其中IRB(S)計算法 – 監管公式方法 | - | - | - |
| 15 | 其中STC(S)計算法 | - | - | - |
| 16 | 市場風險 | 27,673,863 | 28,471,388 | 2,213,909 |
| 17 | 其中STM計算法 | 27,673,863 | 28,471,388 | 2,213,909 |
| 18 | 其中IMM計算法 | - | - | - |
| 19 | 業務操作風險 | 11,719,050 | 11,156,025 | 937,524 |
| 20 | 其中BIA計算法 | 11,719,050 | 11,156,025 | 937,524 |
| 21 | 其中STO計算法 | - | - | - |
| 21a | 其中ASA計算法 | - | - | - |
| 22 | 其中AMA計算法 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 23 | 低於扣減門檻的數額 (須計算250%風險權重) | 1,301,028 | 1,301,028 | 104,082 |
| 24 | 資本下限調整 | - | - | - |
| 24a | 風險加權數額扣減 | - | - | - |
| 24b | 其中不包括在二級資本內的一般銀行業務風險監管儲備及集體準備金的部分 | - | - | - |
| 24c | 其中不包括在二級資本內的土地及建築物因價值重估而產生的累積公平價值收益的部分 | - | - | - |
| 25 | 總計 | 323,610,872 | 325,210,516 | 25,888,869 |

2017年第一季內，風險加權資產總值減少16億港元，主要由於衍生工具的對手方信用風險加權資產減少所至。