

流動性覆蓋比率標準披露模版<sup>a</sup>

為計算截至 9月30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: ( 3 )		貨幣: (港幣)		於「流動性狀況申報表」(MA(BS)1E)的對應項目
披露基礎: 綜合 / 非綜合 / 香港辦事處(刪去不適用者)		未加權數額 (平均值)	加權數額 (平均值)	
<b>A. 優質流動資產</b>				
1	優質流動資產 (HQLA) 總額		35,270,041	第2(I)部A節第4項 (- 第6項, 如適用)
<b>B. 現金流出</b>				
2	零售存款及小型企業借款, 其中:	125,975,949	8,541,428	第2(I)部B節第 1 + 2 + 3 + 4 項
3	穩定零售存款及穩定小型企業借款	4,357,857	217,893	第2(I)部B節第 1(a) + 2(a) + 3(a) + 4(a) 分項
4	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	44,852,621	4,485,262	第2(I)部B節第 1(b) + 2(b) + 3(b) + 4(b) 分項
5	零售定期存款及小型企業定期借款	76,765,470	3,838,273	第2(I)部B節第 1(c) + 2(c) + 3(c) + 4(c) 分項
6	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:	115,861,610	79,304,994	第2(I)部B節第 5 + 6 + 7 項
7	營運存款	6,506,137	999,508	第2(I)部B節第 5(a) + 5(b) 分項
8	第7項未涵蓋的無抵押批發借款 (小型企業借款除外)	104,174,844	73,124,858	第2(I)部B節第 6(a)(i) + 6(a)(ii) + 6(b) 分項
9	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	5,180,629	5,180,629	第2(I)部B節第 7 項
10	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		0	第2(I)部B節第 8 + 9項
11	額外規定, 其中:	12,121,672	1,944,278	第2(I)部B節第 10 至 19 項
12	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	825,282	825,282	第2(I)部B節第10 + 11 + 12 + 13 + 14 + 15 + 16 項
13	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	0	0	第2(I)部B節第17 + 18 項
14	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	11,296,390	1,118,996	第2(I)部B節第 19 項
15	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	5,355,179	5,355,179	第2(I)部B節第 20 + 22 項
16	其他或有出資義務(不論是合約或非合約義務)	48,498,024	211,735	第2(I)部B節第 21 項
17	<b>現金流出總額</b>		<b>95,357,615</b>	Pa第2(I)部B節第 23 項
<b>C. 現金流入</b>				
18	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	0	0	第2(I)部C節第 1 + 2 + 3 項
19	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	83,370,518	71,921,521	第2(I)部C節第 4 + 8項
20	其他現金流入	61,798,564	2,525,356	第2(I)部C節第 5 + 6 + 7 + 9 + 10 項
21	<b>現金流入總額</b>	<b>145,169,082</b>	<b>74,446,877</b>	第2(I)部C節第 11 項
<b>D. 流動性覆蓋比率</b>				
<b>經調整價值</b>				
22	HQLA總額		35,270,041	第2(I)部A節第 7 項
23	淨現金流出總額		24,151,451	第2(I)部B節第 23 項 - 第2(I)部C節第 1 2項
24	<b>LCR (%)</b>		<b>146.12%</b>	第2(I)部D節

<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).