

流動性覆蓋比率標準披露模版*

為計算截至二零一五年九月三十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：(港幣百萬元)		
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)	於「流動性狀況申報表」(MA(BS)1E)的對應項目
A. 優質流動資產				
1	優質流動資產 (HQLA) 總額		42,535	第2(I)部A節第4項 (- 第6項, 如適用)
B. 現金流出				
2	零售存款及小型企業借款, 其中:	229,669	17,716	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	33,464	1,673	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	124,657	12,466	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存款	71,548	3,577	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:	132,469	67,387	第2(I)部B節第 5 + 6 + 7 項
7	營運存款	0	0	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)	126,168	61,086	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	6,301	6,301	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)	8,981	0	第2(I)部B節第 8 + 9項
11	額外規定, 其中:	105,131	15,850	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	6,190	6,190	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	98,941	9,660	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	7,581	8,505	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)	147,414	3,014	第2(I)部B節第 21 項
17	現金流出總額		112,472	第2(I)部B節第 23 項
C. 現金流入				
18	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	2,520	2,468	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	122,025	73,040	第2(I)部C節第 4 + 8項
20	其他現金流入	4,693	4,313	第2(I)部C節第 5 + 6 + 7 + 9 + 10 項
21	現金流入總額	129,238	79,821	第2(I)部C節第 11 項
D. 流動性覆蓋比率				經調整價值
22	HQLA總額		42,535	第2(I)部A節第 7 項
23	淨現金流出總額		32,653	第2(I)部B節第 23 項 - 第2(I)部C節第 12項
24	LCR (%)		132.09%	第2(I)部D節

* 第1類機構根據《銀行業(披露)規則》第30A、51A或103A條(以適用者為準)披露其流動性資料時, 必須使用本標準披露模版。有關填寫本模版的指示(包括個別披露項目的計算方法), 請參閱隨附的填報指示。