INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA (ASIA) LIMITED

中 國 工 商 銀 行(亞 洲)有 限 公 司

（於香港註冊成立之有限公司）

有關流動性覆蓋比率披露標準模版

二零一六年第三季度

為計算截至二零一六年九月三十一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：(77)		貨幣：(港幣千港元)	
披露基礎：非綜合		未加權數額(平均值) 第三季度	加權數額(平均值) 第三季度
A. 優質流動資產			
1	優質流動資產 (HQLA) 總額		72,068,295
B. 現金流出			
2	零售存款及小型企業借款，其中：	111,766,757	10,806,449
3	穩定零售存款及穩定小型企業借款	7,404,540	370,227
4	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	104,362,217	10,436,222
5	零售定期存款及小型企業定期借款	–	–
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：	237,513,680	137,000,000
7	營運存款	11,581,265	2,832,433
8	第 7 項未涵蓋的無抵押批發借款 (小型企業借款除外)	217,644,808	125,879,961
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	8,287,607	8,287,606
10	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		1,750,539
11	額外規定，其中：	57,700,004	8,641,417
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	3,191,230	3,191,230
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	–	–
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	54,508,774	5,450,187
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	31,615	32,610
16	其他或有出資義務(不論是合約或非合約義務)	767,443,898	922,218
17	現金流出總額		159,153,233
C. 現金流入			
18	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	323,430	–
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	131,508,145	104,791,574
20	其他現金流入	7,654,949	5,262,734
21	現金流入總額	–	110,054,308
D. 流動性覆蓋比率			
22	HQLA 總額		69,981,971
23	**淨現金流出總額**		49,291,560
24	**LCR (%)**		143.81%