



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

二零一八年第一季度

在計算本模版所載的流動性覆蓋比率(LCR)及相關組成項目的平均值時所使用的數據點數目: (72)		港元等值	
		(a)	(b)
披露基礎: 綜合		非加權值	加權值
		(平均)	(平均)
A. 優質流動資產			
1	優質流動資產 (HQLA) 總額		83,538,175
B. 現金流出			
2	零售存款及小型企業借款，其中：	135,186,289	12,859,659
3	穩定零售存款及穩定小型企業借款	9,466,555	287,686
4	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	125,719,734	12,571,973
4a	零售定期存款及小型企業定期借款	-	-
5	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：	288,942,686	152,864,815
6	營運存款	15,734,719	3,856,651
7	第7項未涵蓋的無抵押批發借款 (小型企業借款除外)	263,744,671	139,544,868
8	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	9,463,296	9,463,296
9	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		4,588,475
10	額外規定，其中：	47,000,434	8,370,158
11	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	4,296,631	4,088,829
12	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	-	-
13	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	42,703,803	4,281,329
14	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	2,191,180	2,191,180
15	其他或有出資義務(不論是合約或非合約義務)	566,960,008	975,020
16	現金流出總額		181,849,307
C. 現金流入			
17	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	2,529,458	-
18	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	149,564,960	121,066,421
19	其他現金流入	14,483,636	10,878,058
20	現金流入總額	-	131,944,479
D. 流動性覆蓋比率			
經調整價值			
21	HQLA總額		83,538,175
22	淨現金流出總額		51,800,139
23	LCR (%)		167.17%