



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)

有關槓桿比率披露標準模版

二零一八年六月三十日

1(a) 於二零一八年六月三十日的槓桿比率

		(a)	(b)
		千港元	
		T	T-1
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內風險承擔（不包括由衍生工具合約或證券融資交易(SFT)產生的風險承擔，但包括抵押品）	910,085,043	853,342,765
2	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	(4,443,652)	(4,544,130)
3	資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及 SFT）	905,641,391	848,798,635
由衍生工具合約產生的風險承擔			
4	所有與衍生工具合約有關的重置成本（如適用的話，扣除合資格現金變動保證金及 / 或雙邊淨額結算）	12,222,609	14,020,019
5	所有與衍生工具合約有關的潛在未來風險承擔的附加數額	9,134,981	9,577,216
6	還原因提供予對手方而須根據適用會計框架從資產負債表中扣減的衍生工具抵押品的數額	-	-
7	扣減：就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收部分	(1,953,072)	(1,378,334)
8	扣減：中央交易對手方風險承擔中與客戶結算交易有關而獲豁免的部分	-	-
9	經調整後已出售信用衍生工具合約的有效名義數額	-	-
10	扣減：就已出售信用衍生工具合約作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減	-	-
11	衍生工具合約產生的風險承擔總額	19,404,518	22,218,901
由 SFT 產生的風險承擔			
12	經銷售會計交易調整後（在不確認淨額計算下）的 SFT 資產總計	58,852,720	51,987,268
13	扣減：SFT 資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額	-	-
14	SFT 資產的對手方信用風險承擔	5,564,096	5,359,978
15	代理交易風險承擔	-	-
16	由 SFT 產生的風險承擔總額	64,416,816	57,347,246
其他資產負債表外風險承擔			
17	資產負債表外風險承擔名義數額總額	235,771,542	241,126,328
18	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	(178,581,218)	(184,903,731)
19	資產負債表外項目	57,190,324	56,222,597
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	107,919,636	106,738,577
20a	為特定準備金及集體準備金作出調整前的風險承擔總額	1,046,653,049	984,587,379
20b	為特定準備金及集體準備金作出的調整	(5,286,771)	(4,866,247)
21	為特定準備金及集體準備金作出調整後的風險承擔總額	1,041,366,278	979,721,132
槓桿比率			
22	槓桿比率	10.36%	10.89%

1(b) 於二零一八年六月三十日的對賬摘要比較表

		(a)
	項目	在槓桿比率框架下的值 (千港元)
1	已發布的財務報表所載的綜合資產總額	975,202,788
2	對為會計目的須作綜合計算，但在監管綜合範圍以外的銀行、金融、保險或商業實體的投資而須作的相關調整	1,100,758
3	根據認可機構的適用會計框架於資產負債表內確認，但不包括在槓桿比率風險承擔計量值內的任何受信資產而須作的相關調整	-
4	有關衍生工具合約的調整	7,181,909
5	有關證券融資交易的調整（即回購交易及其他類似的有抵押借貸）	5,564,096
6	有關資產負債表外項目的調整（即資產負債表外風險承擔轉換為信貸等值數額）	57,190,124
6a	可從風險承擔計量豁除的集體準備金及特定準備金的調整	(5,286,771)
7	其他調整	413,174
8	槓桿比率風險承擔計量	1,041,366,278