



# 中国建设银行(亚洲)股份有限公司

监管披露

2017年 9月30日

(未经审核)

中国建设银行（亚洲）股份有限公司  
监管披露  
2017年09月30日  
港币千元

### 主要资本比率

以下披露乃根据计算资本充足比率之综合基础而编制，并根据《银行业（披露）规则》作出。

### 资本充足比率

截至2017年9月30日，资本充足比率按照《银行业（资本）规则》编制。

|            | <u>2017年09月30日</u> |
|------------|--------------------|
| 资本         |                    |
| 普通股权一级资本   | 48,238,102         |
| 一级资本       | 48,238,102         |
| 总资本        | 57,294,984         |
| 总风险加权资产    | 344,469,341        |
| 资本充足比率     |                    |
| 普通股权一级资本比率 | 14.00%             |
| 一级资本比率     | 14.00%             |
| 总资本比率      | 16.63%             |

### 杠杆比率

截至2017年9月30日的杠杆比率按照香港金融管理局发行的杠杆比率框架编制。

|           | <u>2017年09月30日</u> |
|-----------|--------------------|
| 资本和风险承担总额 |                    |
| 一级资本      | 48,238,102         |
| 风险承担总额    | 494,796,163        |
| 杠杆比率      | 9.75%              |

中国建设银行(亚洲)股份有限公司  
 监管披露  
 2017年09月30日  
 港币千元

OV1: 风险加权数额概览

下表载列信贷风险、市场风险及营运风险的风险加权资产细目分析，概述各类风险的资本规定。最低资本规定指须就相关风险持有的资本额，按其风险加权金额乘以8%计算。

|     |  | 风险加权数额      |             | 最低资本规定      |
|-----|--|-------------|-------------|-------------|
|     |  | 2017年09月30日 | 2017年06月30日 | 2017年09月30日 |
| 1   | 非证券化类别风险承担的信用风险                        | 297,043,140 | 288,593,002 | 23,763,451  |
| 2   | 其中STC算法                                | 297,043,140 | 288,593,002 | 23,763,451  |
| 2a  | 其中BSC算法                                | -           | -           | -           |
| 3   | 其中IRB算法                                | -           | -           | -           |
| 4   | 对手方信用风险                                | 6,744,760   | 6,371,717   | 539,581     |
| 5   | 其中 SA-CCR算法                            | -           | -           | -           |
| 5a  | 其中现行风险承担方法                             | 5,133,822   | 4,905,954   | 410,706     |
| 6   | 其中IMM(CCR)算法                           | -           | -           | -           |
| 7   | 使用市场基准算法的银行帐内股权风险承担                    | -           | -           | -           |
| 8   | 集体投资计划风险承担 - LTA                       | -           | -           | -           |
| 9   | 集体投资计划风险承担 - MBA                       | -           | -           | -           |
| 10  | 集体投资计划风险承担 - FBA                       | -           | -           | -           |
| 11  | 交收风险                                   | -           | -           | -           |
| 12  | 银行帐内的证券化类别风险承担                         | -           | -           | -           |
| 13  | 其中IRB(S)算法 - 评级基准方法                    | -           | -           | -           |
| 14  | 其中IRB(S)算法 - 监管公式方法                    | -           | -           | -           |
| 15  | 其中STC(S)算法                             | -           | -           | -           |
| 16  | 市场风险                                   | 27,389,050  | 26,809,438  | 2,191,124   |
| 17  | 其中STM算法                                | 27,389,050  | 26,809,438  | 2,191,124   |
| 18  | 其中IMM算法                                | -           | -           | -           |
| 19  | 业务操作风险                                 | 11,991,363  | 11,897,750  | 959,309     |
| 20  | 其中BIA算法                                | 11,991,363  | 11,897,750  | 959,309     |
| 21  | 其中STO算法                                | -           | -           | -           |
| 21a | 其中ASA算法                                | -           | -           | -           |
| 22  | 其中AMA算法                                | 不适用         | 不适用         | 不适用         |
| 23  | 低于扣减门槛的数额(须计算250%风险权重)                 | 1,301,028   | 1,301,028   | 104,082     |
| 24  | 资本下限调整                                 | -           | -           | -           |
| 24a | 风险加权数额扣减                               | -           | -           | -           |
| 24b | 其中不包括在二级资本内的一般银行业务风险监管储备及集体准备金的部分      | -           | -           | -           |
| 24c | 其中不包括在二级资本内的土地及建筑物因价值重估而产生的累积公允价值收益的部分 | -           | -           | -           |
| 25  | 总计                                     | 344,469,341 | 334,972,935 | 27,557,547  |

2017年第三季内，风险加权资产总值增加94.96亿港元，主要由于非证券化类别信用风险加权资产增加所至。