



中国建设银行(亚洲)股份有限公司

监管披露

2018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
 2018年09月30日
 港币千元

KM1: 主要审慎比率

	(a)	(b)	(c)	(d)	(e)
	2018年09月 30日	2018年06月 30日	2018年03月 31日	2017年12月 31日	2017年09月 30日
监管资本（数额）					
1 普通股一级(CET1)	52,227,241	51,147,720	49,400,837	48,625,898	48,238,102
2 一级	60,038,973	58,959,452	57,212,569	56,438,098	48,238,102
3 总资本	68,946,141	67,652,577	66,806,574	65,516,482	57,294,984
风险加权数额（数额）					
4 风险加权数额总额	348,069,340	364,363,519	367,725,996	367,439,731	344,469,341
风险为本监管资本比率（以风险加权数额的百分率表示）					
5 CET1比率 (%)	15.00	14.04	13.43	13.23	14.00
6 一级比率 (%)	17.25	16.18	15.56	15.36	14.00
7 总资本比率 (%)	19.81	18.57	18.17	17.83	16.63
额外CET1缓冲要求（以风险加权数额的百分率表示）					
8 防护缓冲资本要求 (%)	1.88	1.88	1.88	1.25	1.25
9 逆周期缓冲资本要求 (%)	1.45	1.44	1.42	0.94	0.98
10 较高吸收亏损能力要求 (%)（只适用于G-SIB或D-SIB）	0	0	0	0	0
11 认可机构特定的总CET1缓冲要求 (%)	3.33	3.32	3.29	2.19	2.23
12 符合认可机构的最低资本规定后可用的CET1 (%)	10.50	9.54	8.93	8.73	8.00
《巴塞尔协定三》杠杆比率					
13 总杠杆比率风险承担计量	482,973,669	538,023,838	512,617,934	547,117,610	494,796,163
14 杠杆比率(LR) (%)	12.43	10.96	11.16	10.32	9.75
流动性覆盖比率(LCR) / 流动性维持比率(LMR)					
只适用于第1类机构:					
15 优质流动资产(HQLA)总额	58,108,720	59,510,325	64,052,180	67,299,584	47,348,960
16 净现金流出总额	25,649,355	35,487,008	44,823,242	37,032,023	33,652,992
17 LCR (%)	231.83	168.95	144.74	187.47	138.28
只适用于第2类机构:					
17a LMR (%)	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用
稳定资金净额比率(NSFR) / 核心资金比率(CFR)					
只适用于第1类机构:					
18 可用稳定资金总额	327,223,092	324,187,296	332,353,538	不适用	不适用
19 所需稳定资金总额	239,241,739	253,184,082	262,620,321	不适用	不适用
20 NSFR (%)	136.78	128.04	126.55	不适用	不适用
只适用于第2A类机构:					
20a CFR (%)	不适用	不适用	不适用	不适用	不适用

中国建设银行（亚洲）股份有限公司
 监管披露
 2018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。

		(a)	(b)	(c)
		风险加权数额		最低资本规定
		2018年09月30日	2018年06月30日	2018年09月30日
1	非证券化类别风险承担的信用风险	303,357,565	319,888,040	24,268,605
2	其中STC算法	303,357,565	319,888,040	24,268,605
2a	其中BSC算法	-	-	-
3	其中基础IRB算法	-	-	-
4	其中监管分类准则算法	-	-	-
5	其中高级IRB算法	-	-	-
6	对手方违约风险及违约基金承担	2,775,159	2,757,425	222,013
7	其中SA-CCR	-	-	-
7a	其中现行风险承担方法	2,775,159	2,743,072	222,013
8	其中IMM(CCR)算法	-	-	-
9	其中其他	-	14,353	-
10	CVA风险	1,039,475	1,139,163	83,158
11	简单风险权重方法及内部模式方法下的银行帐内股权状况	-	-	-
12	集体投资计划风险承担—LTA	-	-	-
13	集体投资计划风险承担—MBA	-	-	-
14	集体投资计划风险承担—FBA	-	-	-
14a	集体投资计划风险承担—混合使用算法	-	-	-
15	交收风险	-	-	-
16	银行帐内的证券化类别风险承担	-	-	-
17	其中SEC-IRBA	-	-	-
18	其中SEC-ERBA	-	-	-
19	其中SEC-SA	-	-	-
19a	其中SEC-FBA	-	-	-
20	市场风险	26,170,138	26,062,713	2,093,611
21	其中STM算法	26,170,138	26,062,713	2,093,611
22	其中IMM算法	-	-	-
23	交易帐与银行帐之间切换的风险承担的资本要求（经修订市场风险框架生效前不适用）	-	-	-
24	业务操作风险	13,425,975	13,215,150	1,074,078
25	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
26	资本下限调整	-	-	-
26a	风险加权数额扣减	-	-	-
26b	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	-	-	-
26c	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	-	-	-
27	总计	348,069,340	364,363,519	27,845,547

2018 第三季内，风险加权资产总值增加162.94亿港元，主要由于非证券化类别信用风险加权资产减少所致。

中国建设银行（亚洲）股份有限公司
 监管披露
 2018年09月30日
 港币千元

LR2: 杠杆比率

		(a)	(b)
		2018年09月30日	2018年06月30日
资产负债表内风险承担			
1	资产负债表内风险承担（不包括由衍生工具合约或证券融资交易(SFT)产生的风险承担，但包括抵押品）	457,491,004	509,468,779
2	扣减：断定一级资本时所扣减的资产数额	(342,694)	(302,809)
3	资产负债表内风险承担总额（不包括衍生工具合约及SFT）	457,148,310	509,165,970
由衍生工具合约产生的风险承担			
4	所有与衍生工具合约有关的重置成本（如适用的话，扣除合资格现金变动保证金及/或双边净额结算）	4,361,423	3,697,738
5	所有与衍生工具合约有关的潜在未来风险承担的附加数额	4,169,883	4,491,299
6	还原因提供予对手方而须根据适用会计框架从资产负债表中扣减的衍生工具抵押品的数额	-	-
7	扣减：就衍生工具合约提供的现金变动保证金的应收部分	(325,905)	(33,898)
8	扣减：中央交易对手方风险承担中与客户结算交易有关而获豁免的部分	-	-
9	经调整后已售出信用衍生工具合约的有效名义数额	-	-
10	扣减：就已售出信用衍生工具合约作出调整的有效名义抵销及附加数额的扣减	-	-
11	衍生工具合约产生的风险承担总额	8,205,401	8,155,139
由SFT产生的风险承担			
12	经销售会计交易调整后（在不确认净额计算下）的SFT资产总计	1,769,139	3,782,118
13	扣减：SFT资产总计的应付现金与应收现金相抵后的净额	-	-
14	SFT资产的对对手方信用风险承担	127	28,850
15	代理交易风险承担	-	-
16	由SFT产生的风险承担总额	1,769,266	3,810,968
其他资产负债表外风险承担			
17	资产负债表外风险承担名义数额总额	84,269,468	83,571,783
18	扣减：就转换为信贷等值数额作出的调整	(66,639,693)	(65,097,335)
19	资产负债表外项目	17,629,775	18,474,448
资本及风险承担总额			
20	一级资本	60,038,973	58,959,452
20a	为特定准备金及集体准备金作出调整前的风险承担总额	484,752,752	539,606,525
20b	为特定准备金及集体准备金作出的调整	(1,779,083)	(1,582,687)
21	为特定准备金及集体准备金作出调整后的风险承担总额	482,973,669	538,023,838
杠杆比率			
22	杠杆比率	12.43%	10.96%

LIQ1: 流动性覆盖比率(LCR)—第1类机构

下表显示LCR及优质流动资产(HQLA)的详细资料, 以及现金流出与流入的细目分类:

	季度结算至 2018年9月30日 (76个数据点)		季度结算至 2018年6月30日 (73个数据点)	
	港元等值		港元等值	
	(a) 非加权值 (平均)	(b) 加权值 (平均)	(a) 非加权值 (平均)	(b) 加权值 (平均)
披露基础: 香港办事处				
A. 优质流动资产				
1 优质流动资产(HQLA)总额		58,108,720		59,510,325
B. 现金流出				
2 零售存款及小型企业借款, 其中:	213,184,918	14,678,760	206,604,890	14,155,309
3 稳定零售存款及稳定小型企业借款	3,689,674	110,690	3,759,328	112,780
4 较不稳定零售存款及较不稳定小型企业借款	81,866,145	8,186,615	78,005,004	7,800,501
4a 零售定期存款及小型企业定期借款	127,629,099	6,381,455	124,840,558	6,242,028
5 无抵押批发借款(小型企业借款除外)及认可机构发行的债务证券及订明票据, 其中:	96,307,354	63,726,948	101,552,010	66,333,957
6 营运存款	-	-	-	-
7 第6行未涵盖的无抵押批发借款(小型企业借款除外)	96,184,479	63,604,073	101,122,057	65,904,004
8 由认可机构发行并可在LCR涵盖时期内赎回的债务证券及订明票据	122,875	122,875	429,953	429,953
9 有抵押借款交易(包括证券掉期交易)	-	-	-	-
10 额外规定, 其中:	26,802,500	7,349,706	26,788,469	6,646,906
11 衍生工具合约及其他交易所产生的现金流出, 以及相关抵押品规定所产生的额外流动性需要	2,747,119	2,747,119	2,099,191	2,099,191
12 因结构性金融交易下的义务及因付还从该等交易取得的借款而产生的现金流出	-	-	-	-
13 未提取的有承诺融通(包括有承诺信贷融通及有承诺流动性融通)的潜在提取	24,055,381	4,602,587	24,689,278	4,547,715
14 合约借出义务(B节未以其他方式涵盖)及其他合约现金流出	3,129,409	3,129,409	2,483,852	2,483,852
15 其他或有出资义务(不论合约或非合约义务)	80,523,800	416,656	76,293,420	383,245
16 现金流出总额		89,301,479		90,003,269
C. 现金流入				
17 有抵押借出交易(包括证券掉期交易)	1,169,734	-	527,151	-
18 有抵押或无抵押贷款(第17行涵盖的有抵押借出交易除外)及存于其他金融机构的营运存款	101,608,366	60,298,133	87,697,685	49,397,404
19 其他现金流入	71,832,786	3,966,587	72,976,688	5,118,857
20 现金流入总额	174,610,886	64,264,720	161,201,524	54,516,261
D. LCR(经调整价值)				
21 HQLA总额		58,108,720		59,510,325
22 净现金流出总额		25,649,355		35,487,008
23 LCR (%)		231.83		168.95