



始於1908 您的財富管理銀行

交通銀行股份有限公司 香港分行

(於中華人民共和國註冊成立)

財務資料
披露聲明書

2018年09月30日
(未經審計)

交通銀行股份有限公司香港分行

香港中環畢打街20號

www.bankcomm.com.hk

交通銀行股份有限公司香港分行
(於中華人民共和國註冊成立)

財務資料披露聲明書 (未經審計)

目錄

頁碼

I. 流動性資料

2 - 4

交通銀行股份有限公司香港分行
(於中華人民共和國註冊成立)

以下披露按照《銀行業（披露）規則》及香港金融管理局頒佈的披露模版編製。本報表分別以中英文編製，在對中、英文文本的理解上發生歧義時，以英文文本為準。

I. 流動性資料

	2018-09-30 港幣千位	2018-06-30 港幣千位
季度平均流動性覆蓋比率（“LCR”）	132.31%	165.96%
可用穩定資金總額	247,944,625	247,309,995
所需穩定資金總額	224,153,780	234,629,408
穩定資金淨額比率（“NSFR”）	110.61%	105.40%

LIQ1: 流動性覆蓋比率（“LCR”）- 第1類機構

分行的資金來源以客戶存款為基礎，一方面致力加強核心存款的穩定性，同時通過不同資金渠道分散資金來源以增強分行於市場上的融資能力。分行積極參與貨幣市場交易，發行存款證及中期票據以獲取短期及中長期資金，及保持與總行進行定期資金調度安排，以維護迅速之內部備用資金提供渠道。分行對內部融資所作的監控與第三方交易一致；而總行設有內部限度，以控制分行對總行資金的依賴。

分行的主要流動性風險來自於資產及負債的期限錯配，為確定資金需要，對不同到期日期檔表內外資產負債的現金流進行日常分析及預測工作。分行同時對表外融資承擔（例如授信承諾、保函等業務）作密切監控，並評估其對分行流動性的潛在影響。分行亦致力維持資產的高度流通性，一旦市場發生未可預期的流動性衝擊，可以迅速出售資產變現。

分行優質流動資產組合中大部份為一級優質流動資產，當中包括存放香港金融管理局結餘、外匯基金票據及無變現障礙的主權債券。同時，亦持有二A及二B級別的優質流動資產，當中包括信貸評級高之公司債券。

分行之表外衍生工具及需要提供額外抵押品的可能性對流動性覆蓋比率淨現金流出影響並不顯著。

為覆蓋主要外幣的流動性覆蓋比率淨現金流出，分行持有相應外幣（主要為人民幣及美元）之一級優質流動資產。分行之外幣流動性覆蓋比率錯配主要以港元優質流動資產透過外匯掉期交易支持。分行已按金管局LM-1修訂之主要貨幣的流動性管理指引設立了相關貨幣之一級優質流動資產比率內部要求。

分行為流動性覆蓋比率設立內部限額及預警水平以確保流動性風險水平控制於其風險胃納範圍內。

交通銀行股份有限公司香港分行
(於中華人民共和國註冊成立)

I. 流動性資料 (續)

LIQ1: 流動性覆蓋比率 (“LCR”) – 第 1 類機構(續)

2018 年第 3 季:

在計算截至 2018 年 9 月 30 日止季度的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: (76)		港幣千位	
披露基礎: 香港辦事處		非加權值 (平均)	加權值 (平均)
A. 優質流動資產			
1.	優質流動資產(HQLA)總額		85,404,512
B. 現金流出			
2.	零售存款及小型企業借款, 其中:	1,657,986	153,737
3.	穩定零售存款及穩定小型企業借款	77,556	3,878
4.	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	1,416,750	141,675
4a.	零售定期存款及小型企業定期借款	163,680	8,184
5.	無抵押批發借款(小型企業借款除外)及認可機構發行的債務證券及訂明票據, 其中:	183,539,329	97,249,824
6.	營運存款	14,801,692	3,691,373
7.	第 6 行未涵蓋的無抵押批發借款(小型企業借款除外)	168,503,670	93,324,484
8.	由認可機構發行並可在 LCR 涵蓋時期內贖回的債務證券及訂明票據	233,967	233,967
9.	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		347,441
10.	額外規定, 其中:	36,694,888	7,612,786
11.	衍生工具合約及其他交易所產生的現金流出, 以及相關抵押品規定所產生的額外流動性需要	6,273,839	3,070,828
12.	因結構式金融交易下的義務及因付還從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	30,421,049	4,541,958
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	7,922,538	7,922,538
15.	其他或有出資義務(不論合約或非合約義務)	34,406,998	799,639
16.	現金流出總額		114,085,965
C. 現金流入			
17.	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	-	-
18.	有抵押或無抵押貸款(第 17 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	96,702,128	42,637,782
19.	其他現金流入	6,084,622	6,084,622
20.	現金流入總額	102,786,750	48,722,404
D. LCR			
21.	HQLA 總額		85,404,512
22.	淨現金流出總額		65,363,561
23.	LCR (%)		132.31%

交通銀行股份有限公司香港分行
(於中華人民共和國註冊成立)

I. 流動性資料 (續)

LIQ1: 流動性覆蓋比率 (“LCR”) – 第 1 類機構 (續)

2018 年第 2 季:

在計算截至 2018 年 6 月 30 日止季度的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: (73)		港幣千位	
		非加權值 (平均)	加權值 (平均)
披露基礎: 香港辦事處			
A. 優質流動資產			
1.	優質流動資產(HQLA)總額		104,817,748
B. 現金流出			
2.	零售存款及小型企業借款, 其中:	1,761,207	164,872
3.	穩定零售存款及穩定小型企業借款	69,313	3,466
4.	較不穩定零售存款及較不穩定小型企業借款	1,536,226	153,623
4a.	零售定期存款及小型企業定期借款	155,668	7,783
5.	無抵押批發借款(小型企業借款除外)及認可機構發行的債務證券及訂明票據, 其中:	258,886,096	115,665,292
6.	營運存款	89,020,488	22,254,324
7.	第 6 行未涵蓋的無抵押批發借款(小型企業借款除外)	168,216,054	91,761,414
8.	由認可機構發行並可在 LCR 涵蓋時期內贖回的債務證券及訂明票據	1,649,554	1,649,554
9.	有抵押借款交易(包括證券掉期交易)		587,030
10.	額外規定, 其中:	21,250,503	5,310,477
11.	衍生工具合約及其他交易所產生的現金流出, 以及相關抵押品規定所產生的額外流動性需要	2,908,209	2,331,446
12.	因結構式金融交易下的義務及因付還從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	18,342,294	2,979,031
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	5,096,193	5,096,193
15.	其他或有出資義務(不論合約或非合約義務)	35,891,379	805,114
16.	現金流出總額		127,628,978
C. 現金流入			
17.	有抵押借出交易(包括證券掉期交易)	-	-
18.	有抵押或無抵押貸款(第 17 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	93,765,616	55,706,346
19.	其他現金流入	7,382,012	7,382,012
20.	現金流入總額	101,147,628	63,088,358
D. LCR			經調整價值
21.	HQLA 總額		104,817,748
22.	淨現金流出總額		64,540,620
23.	LCR (%)		165.96%

廖宏傑, 候補行政總裁
二零一八年十一月二十三日