

槓桿比率通用披露模版

於二零一五年六月三十日

項目	槓桿比率框架 等值千港元
資產負債表內風險承擔	
1 資產負債表內項目(不包括衍生工具及證券融資交易, 但包括抵押品)	77,988,241
2 扣減: 斷定《巴塞爾協定三》一級資本時所扣減的資產數額(以負數表示)	(3,527,690)
3 資產負債表內風險承擔總額(不包括衍生工具及證券融資交易)(第1及2行相加之數)	74,460,551
衍生工具風險承擔	
4 所有與衍生工具交易有關的重置成本(即扣除合資格現金變動保證金)	705,335
5 所有與衍生工具交易有關的潛在未來風險承擔的附加數額	770,158
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: 就衍生工具交易提供的現金變動保證金的應收部分(以負數表示)	
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(以負數表示)	
9 經調整後已出售信用衍生工具的有效名義數額	
10 扣減: 就已出售信用衍生工具作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減(以負數表示)	
11 衍生工具風險承擔總額(第4至10行相加之數)	1,475,493
證券融資交易風險承擔	
12 經銷售會計交易調整後(在不確認淨額計算下)的證券融資交易資產總計	10,630,970
13 扣減: 證券融資交易資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額(以負數表示)	
14 證券融資交易資產的對手方信用風險承擔	457,339
15 代理交易風險承擔	
16 證券融資交易風險承擔總額(第12至15行相加之數)	11,088,309
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計	28,372,797
18 扣減: 就轉換為信貸等值數額作出的調整(以負數表示)	(24,743,764)
19 資產負債表外項目(第17及18行相加之數)	3,629,033
資本及風險承擔總額	
20 一級資本	6,489,844
21 風險承擔總額(第3、11、16及19行相加之數)	90,653,386
槓桿比率	
22 《巴塞爾協定三》槓桿比率	7.16%