



东亚银行(中国)有限公司

2024 年第三季度

资本管理第三支柱信息披露报告

目录

1. 引言	1
2. 第三支柱信息披露内容	2
2.1 KM1：监管并表关键审慎监管指标	2
2.2 OV1：风险加权资产概况	3
2.3 LR1：杠杆率监管项目与相关会计项目的差异	3
2.4 LR2：杠杆率	4

1. 引言

(1) 基本信息

东亚银行(中国)有限公司(以下简称“东亚中国”或“本行”)是由在中华人民共和国香港特别行政区注册的东亚银行有限公司(以下简称“东亚银行”或“母行”)在中华人民共和国上海市成立的外商独资法人银行。

本行于 2007 年 3 月 29 日领取了企业法人营业执照。根据本行营业执照的规定，本行经营期限为不约定期限。本行的经营范围为有关监管机构批准的各项外汇业务和人民币业务。

(2) 披露依据

根据国家金融监督管理总局发布的《商业银行资本管理办法》(2023 年 10 月 26 日国家金融监督管理总局令 2023 年第 4 号公布 自 2024 年 1 月 1 日起施行)以及《附件 22：商业银行信息披露内容和要求》的相关规定，本行定期通过公开渠道，向投资者和社会公众披露本行第三支柱相关信息。

2. 第三支柱信息披露内容

对非国内系统重要性银行（除第三档商业银行外），信息披露内容应至少包括风险管理、关键审慎监管指标和风险加权资产概览，资本构成，杠杆率的相关定性和定量信息等。

截至 2024 年 9 月 30 日，东亚银行（中国）有限公司第三支柱相关信息如下表所示：

2.1 KM1：监管并表关键审慎监管指标

单位：人民币万元%		2024 年 9 月 30 日	2024 年 6 月 30 日	2024 年 3 月 31 日
可用资本（数额）				
1	核心一级资本净额	2,158,058	2,169,468	2,175,942
2	一级资本净额	2,158,058	2,169,468	2,175,942
3	资本净额	2,224,301	2,232,076	2,419,543
风险加权资产（数额）				
4	风险加权资产合计	16,115,781	16,715,698	15,627,541
资本充足率				
5	核心一级资本充足率（%）	13.39	12.98	13.92
6	一级资本充足率（%）	13.39	12.98	13.92
7	资本充足率（%）	13.80	13.35	15.48
附加的核心一级资本充足率缓冲要求				
8	储备资本要求（%）	2.50	2.50	2.50
9	逆周期资本要求（%）	-	-	-
10	全球系统重要性银行或国内系统重要性银行附加资本要求（%）	不适用	不适用	不适用
11	其他各级资本要求（%）（8+9+10）	2.50	2.50	2.50
12	满足最低资本要求后的可用核心一级资本占风险加权资产的比例（%）	5.80	5.35	7.48
杠杆率				
13	调整后的表内外资产余额	24,903,444	24,427,381	23,089,647
14	杠杆率（%）	8.67	8.88	9.42
14a	杠杆率 a（%）	8.67	8.88	9.42
流动性覆盖率				
15	合格优质流动性资产	2,003,549	1,956,504	2,027,900
16	现金净流出量	832,035	694,174	589,704
17	流动性覆盖率（%）	240.80	281.85	343.88
净稳定资金比例				
18	可用稳定资金合计	9,860,786	9,812,530	9,537,753
19	所需稳定资金合计	8,507,984	8,635,227	8,153,965

20	净稳定资金比例 (%)	115.90	113.63	116.97
流动性比例				
21	流动性比例 (%)	86.34	88.95	123.30

注：分项数额相加后与总和之间如存在任何差异，则该等差异均为四舍五入约整所造成，下文数据同样适用。

2.2 OV1：风险加权资产概况

单位：人民币万元		风险加权资产			最低资本要求
		2024 年 9 月 30 日	2024 年 6 月 30 日	2024 年 3 月 31 日	2024 年 9 月 30 日
1	信用风险	15,117,617	15,709,297	14,612,519	1,209,409
2	市场风险	348,327	356,564	365,185	27,866
3	操作风险	649,837	649,837	649,837	51,987
4	交易账簿和银行账簿 间转换的资本要求	-	-	-	-
5	合计	16,115,781	16,715,698	15,627,541	1,289,262

2.3 LR1：杠杆率监管项目与相关会计项目的差异

单位：人民币万元		2024 年 9 月 30 日
1	并表总资产	19,348,920
2	并表调整项	-
3	客户资产调整项	-
4	衍生工具调整项	(24,234)
5	证券融资交易调整项	48,879
6	表外项目调整项	5,781,470
7	资产证券化交易调整项	-
8	未结算金融资产调整项	-
9	现金池调整项	-
10	存款准备金调整项（如有）	-
11	审慎估值和减值准备调整项	(250,464)
12	其他调整项	(1,127)
13	调整后表内外资产余额	24,903,444

2.4 LR2：杠杆率

单位：人民币万元%		2024 年 9 月 30 日	2024 年 6 月 30 日
表内资产余额			
1	表内资产（除衍生工具和证券融资交易外）	18,848,592	18,258,538
2	减：减值准备	(243,610)	(220,951)
3	减：一级资本扣除项	(1,127)	(1,179)
4	调整后的表内资产余额（衍生工具和证券融资交易除外）	18,603,854	18,036,408
衍生工具资产余额			
5	各类衍生工具的重置成本（扣除合格保证金，考虑双边净额结算协议的影响）	23,798	46,546
6	各类衍生工具的潜在风险暴露	80,413	67,474
7	已从资产负债表中扣除的抵质押品总和	-	-
8	减：因提供合格保证金形成的应收资产	-	-
9	减：为客户提供清算服务时与中央交易对手交易形成的衍生工具资产余额	-	-
10	卖出信用衍生工具的名义本金	-	-
11	减：可扣除的卖出信用衍生工具资产余额	-	-
12	衍生工具资产余额	104,211	114,020
证券融资交易资产余额			
13	证券融资交易的会计资产余额	371,865	525,263
14	减：可以扣除的证券融资交易资产余额	-	-
15	证券融资交易的交易对手信用风险暴露	48,879	23,332
16	代理证券融资交易形成的证券融资交易资产余额	-	-
17	证券融资交易资产余额	420,744	548,595
表外项目余额			
18	表外项目余额	14,868,851	14,493,548
19	减：因信用转换调整的表外项目余额	(9,087,381)	(8,757,812)
20	减：减值准备	(6,835)	(7,379)
21	调整后的表外项目余额	5,774,635	5,728,357
一级资本净额和调整后的表内外资产余额			
22	一级资本净额	2,158,058	2,169,468
23	调整后表内外资产余额	24,903,444	24,427,381
杠杆率			
24	杠杆率（%）	8.67	8.88
24a	杠杆率 a（%）	8.67	8.88

25	最低杠杆率要求 (%)	4.00	4.00
----	-------------	------	------

注：本行为非上市公司，无季度和半年度经审计的财务报表，因此上述数据均为未经审计数据，最终结果以年度经审计的财务报表为准。

签署



行长助理兼首席财务官

批准



执行董事兼行长

盖章



东亚银行（中国）有限公司