## Z

### **SECRET**



### 高度機密

### under the Banking Ordinance 根據〈銀行業條例〉

RETURN ON SELECTED DATA FOR LIQUIDITY STRESS-TESTING 就流動資金壓力測試提供的指定數據的申報表

POSITION OF THE HONG KONG OFFICES AND OVERSEAS BRANCHES OF A BANK INCORPORATED IN HONG KONG

在香港註冊的銀行	的香港辦事處及海外分行狀況					
As at 截至 (last day of the quarter 該季最後一天)						
Name of Authorized Institution 認可機構名稱	Date of Submission 遞交日期					
The Banking <b>《</b> 銀行業						
Information requested in this return is required under s should be submitted to the Monetary Authority not late on 31 March, 30 June, 30 September and 31 December Authority.	r than 6 weeks after the end of each quarter ending					
除金融管理專員另有指示外,根據《銀行業條例》第63 日、六月三十日、九月三十日及十二月三十一日後起計						
Note: This return is to be prepared in accordance with the co 註: 本申報表須按金融管理專員發出的填報指示填寫。	mpletion instructions issued by the Monetary Authority.					
We certify that this return is, to the best of our knowled 我們據所知及確信,證明本申報表內容均屬正確無誤。	Ige and belief, correct.					
30(13 30) // / / / / / / / / / / / / / / / / /						
Chief Accountant 會計主任	Chief Executive 行政總裁					
Name 姓名	Name 姓名					
Name and telephone number of responsible person who may query. 金融管理專員需要查詢時可聯絡的負責人姓名和電話號						

Telephone Number

電話號碼

MA(BS)18 (6/2005)

Name

姓名

### Part I - Cash-flow information

第I部 - 現金流量資料									(HK\$'000	))(港幣千元)
	Reference:					Matui	ity 期限			
	參照 MA(BS)1/	Closing balance	1st day	2nd day	3rd day	4th day	5th day	6th day	7th day	Over 7 days
	MA(BS)1B	期末餘額	第1日	第2日	第3日	第4日	第5日	第6日	第7日	超過7日
LIABILITY ITEMS										
負債項目										
1. Deposits from customers										
客戶存款										
1.1 Deposits from connected parties										
關連人士的存款										
1.2 Pledged deposits										
已抵押存款										
1.3 Other deposits										
其他存款										
1.4 Total	6									
總 額										
2. Due to banks										
銀行同業存款										
2.1 Bank vostro balances										
銀行同業存款餘額										
2.2 Due to banks - connected parties										
銀行同業存款 -關連人士										4
2.3 Due to banks - pledged										
銀行同業存款 -已抵押										
2.4 Due to banks - other counterparties										
銀行同業存款-其他交易對手										
2.5 Total	8									
總額										
3. Negotiable debt instruments issued and outstanding	9				-			<b>_</b>		
5. Negotiable debt instruments issued and outstanding 已發行及未償還的可轉讓債務工具	9									
L 数 1.1 及 不 頂 退 的 刂 帮 禄 頂 贺 丄 县		ll	<b>I</b>							

(HK\$'000)(港幣千元)

現金  5. Due from banks			-							(HK\$'000	))(港幣千元)
MA(BS)11   Malance   List day   And day   And day   Sh day   Sh day   Chi day   Over 7 days							Matur	ity 期限			
MA(MS)11  期末報報 第1日 第2日 第3日 第4日 第5日 第6日 第7日 超過7日											
SSSETTEMS											
12   12   12   12   13   14   15   15   15   15   15   15   15		MA(BS)1B	期末餘額	第1日	第2日	第3日	第4日	第5日	第6日	第7日	超過7日
12   12   12   13   14   15   15   15   15   15   15   15											
数金	<u>資產項目</u>										
数金	4. Cash	12									
Due from banks											
	70.10										
Solid Bank notifo balances   日本	5. Due from banks										
	存放銀行同業										
5.2 Due from banks - connected parties	5.1 Bank nostro balances										
	存放銀行同業餘額										
5.3 Due from banks - pledged 有	5.2 Due from banks - connected parties										
	存放銀行同業-關連人士										
5.4 Due from banks - other counterparties 存放銀行同業 其他交易對手 5.5 Total 8	5.3 Due from banks - pledged										
## 2											
17   18   18   18   18   18   18   18	5.4 Due from banks - other counterparties										
整新  5. Debt securities held 持有的債務證券  6.1 Exchange Fund Bills and Notes (EFBN) 外匯基金票據及債券  6.2 Securities eligible for rediscount at the Discount Window (other than EFBN) 可处比现金 能力用处现金 含物 是多少外匯基金票據及债券外)  6.3 Other HXD investment grade securities 其他港元投資級別證券  6.4 US Treasuries & other AAA arted USD securities 美國國庫券及其他獲AAA 評級的美元證券  6.5 Other USD investment grade securities 其他美元投資級別證券  6.6 Other securities 其他美元投資級別證券  6.6 Other securities 其他美元投資級別證券  7.1 HOS/ PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款  7.2 HKMC compliant mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款  7.3 Other mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款											
5. Debt securities held 持有的債務證券 6.1 Exchange Fund Bills and Notes (EFBN)		17									
特有的債務證券 6.1 Exchange Fund Bills and Notes (EFBN) 外匯基金票據及債券 6.2 Securities eligible for rediscount at the Discount Window (other than EFBN) 可於貼現適進行再貼現的合資格證券 (外匯基金票據及債券除外) 6.3 Other HKD investment grade securities 其他港元投資級別證券 6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities 美國國庫券及其他獲AAA 評級的美元證券 6.5 Other USD investment grade securities 其他養元投資級別證券 6.6 Other securities 其他證券  7.1 HOS / PSPS mortgage loans 住宅按揭實數 7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款 7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款 7.3 Other mortgage loans	總 額										
特有的債務證券 6.1 Exchange Fund Bills and Notes (EFBN) 外匯基金票據及債券 6.2 Securities eligible for rediscount at the Discount Window (other than EFBN) 可於貼現適進行再貼現的合資格證券 (外匯基金票據及債券除外) 6.3 Other HKD investment grade securities 其他港元投資級別證券 6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities 美國國庫券及其他獲AAA 評級的美元證券 6.5 Other USD investment grade securities 其他養元投資級別證券 6.6 Other securities 其他證券  7.1 HOS / PSPS mortgage loans 住宅按揭實數 7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款 7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款 7.3 Other mortgage loans											
6.1 Exchange Fund Bills and Notes (EFBN)											
外匯基金票據及債券  6.2 Securities eligible for rediscount Window (other than EFBN) 可於貼現會進行再貼現的合資格證券 (外匯基金票據及債券除外)  6.3 Other HKD investment grade securities 其他港元投資級別證券  6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities 美國國庫券及其他獲AAA 評級的美元證券  6.5 Other USD investment grade securities 其 他 美元投資級別證券  6.6 Other Securities 其 他 證券  7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其壓計劃」/「私人機構參建居壓計劃」按揭貸款  7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款  7.3 Other mortgage loans											
6.2 Securities eligible for rediscount at the Discount Window (other than EFBN) 可於貼現窗進行再貼現的合資格證券 (外匯基金票據及債券除外) 6.3 Other HXD investment grade securities 其他港元投資級別證券 6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities 美國國庫券及其他獲 AAA 評級的美元證券 6.5 Other USD investment grade securities 其他美元投資級別證券 6.6 Other securities 其他證券  7. Residential mortgage loans 住宅按揭貸數 7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款 7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款 7.3 Other mortgage loans											
可於貼現窗進行再貼現的合資格證券 (外匯基金票據及債券除外)											
6.3 Other HKD investment grade securities											
其他港元投資級別證券 6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities	可於貼現窗進行再貼現的合資格證券(外匯基金票據及債券除外)		***************************************	***************************************		****	***	***************************************	***************************************	***************************************	
6.4 US Treasuries & other AAA rated USD securities											
美國國庫券及其他獲AAA評級的美元證券         6.5 Other USD investment grade securities 其他美元投資級別證券         6.6 Other securities 其他證券         其他證券         7. Residential mortgage loans 住宅按揭貸款         7.1 HOS/PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款         7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款         7.3 Other mortgage loans         符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款											
6.5 Other USD investment grade securities 其他美元投資級別證券 6.6 Other securities 其他證券  7. Residential mortgage loans 住宅按揭貸款 7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款  7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款  7.3 Other mortgage loans											
其他美元投資級別證券       6.6 Other securities         其他證券       5         7. Residential mortgage loans       6         住宅按揭貸款       6         7.1 HOS / PSPS mortgage loans       7         「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款       7         7.2 HKMC compliant mortgage loans       6         符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款       7         7.3 Other mortgage loans       7	夫國國庫芬及其他獲AAA計級的美兀證芬										
6.6 Other securities											
其他證券  7. Residential mortgage loans 住宅按揭貸款  7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款  7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款  7.3 Other mortgage loans											
7. Residential mortgage loans 住宅按揭貸款 7.1 HOS / PSPS mortgage loans 「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款 7.2 HKMC compliant mortgage loans 符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款											
住宅按揭貸款       7.1 HOS / PSPS mortgage loans <ul> <li>「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款</li> </ul> 7.2 HKMC compliant mortgage loans <ul> <li>符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款</li> </ul> 7.3 Other mortgage loans	大世世ガ										
住宅按揭貸款       7.1 HOS / PSPS mortgage loans <ul> <li>「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款</li> </ul> 7.2 HKMC compliant mortgage loans <ul> <li>符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款</li> </ul> 7.3 Other mortgage loans	7. Residential mortgage loans			<b> </b>							-
7.1 HOS / PSPS mortgage loans         「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款         7.2 HKMC compliant mortgage loans         符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款         7.3 Other mortgage loans								ĺ			
「居者有其屋計劃」/「私人機構參建居屋計劃」按揭貸款       7.2 HKMC compliant mortgage loans       符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款       7.3 Other mortgage loans											
7.2 HKMC compliant mortgage loans     符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款     7.3 Other mortgage loans											
符合香港按揭證券有限公司準則的按揭貸款	7.2 HKMC compliant mortgage loans										
7.3 Other mortgage loans											

# <u>Part II - Supplementary Information</u> 第<u>II部 - 補充資料</u>

1. Due to and due from the same counterparty bank 申報機構與同一交易對手銀行相互結欠的數額

(HK\$'000)(海憋手元)

		(HK\$000)(港幣十元)
Name of counterparty bank 交易對手銀行名稱	a. Amount due to the counterparty bank 申報機構欠交易對手銀行的數額	b. Amount due from the counterparty bank 交易對手銀行欠申報機構的數額
7 % J % J B III		2 2 2 3 2 13 2 1 12 20 113 23 20 20
Total		
總額 二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十二十		

#### 2. Residential mortgage loans

	「居者有其屋計劃」/ 「私人機構	1 00	(HK\$'000)(港幣千元) Other mortgage loans 其他按揭貸款
(a) Delinquent loans			
拖欠貸款			
(b) Loans in negative equity			
<b>备</b> 資 產 按 揚 貸 款			