

王道商業銀行股份有限公司  
香港分行  
(於台灣註冊成立之有限公司)

財務資料披露聲明書  
截至二零二零年九月三十日

## VI. 流動資金

本分行由 2015 年 1 月 1 日起已根據《銀行業 (流動性) 規則》採納流動性維持比率，該比率符合香港金融管理局所訂立的最低 25% 之要求。

平均流動性維持比率是根據財政年度每月的平均流動性維持比率的簡單平均數計算。

	2020 年 7 月 1 日 至 9 月 30 日 <sup>1</sup>	2020 年 4 月 1 日 至 6 月 30 日 <sup>2</sup>
平均流動性維持比率	50.37%	51.12%

<sup>1</sup> 2020 年財政年度的平均流動性維持比率是根據 2020 年財政年度第三季的平均每月流動性維持比率計算。

<sup>2</sup> 2020 年財政年度的平均流動性維持比率是根據 2020 年財政年度第二季的平均每月流動性維持比率計算。

香港分行的資產負債管理委員會負責督導流動性管理的整體監察與監控，成員包含香港分行的行政總裁、金融交易主管、風險管理部主管及作業組主管。流動性管理是遵照分行的流動性管理政策執行，以確保遵循經營所在地的監管規定，以及董事會設定的各項要求和限制。

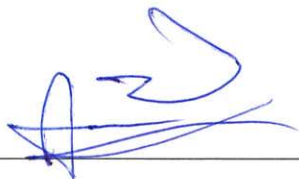
財務部門每日根據〈銀行業條例〉計算流動性維持比率，並向金融交易部及風險管理部報告。香港分行設定流動性風險管理指標和限額，每週用以識別、計量、監測和控制流動性風險，分行亦每月進行現金流量分析及壓力測試以識別流動性風險暴露和可帶來之影響。

王道商業銀行股份有限公司香港分行 (於台灣註冊成立之有限公司)  
財務資料披露報告 (截至二零二零年九月三十日)

## IX. 遵從情況聲明

這是本行發出截至 2020 年 9 月 30 日止財務資料披露報告，此報告依循銀行業 (披露) 規則及香港金融管理局頒布的監管政策手冊之銀行業 (披露) 規則的應用指引的要求而編制。

此報告內容已清楚解釋本行的業務操作，所載的資料在任何要項上並非虛假或具誤導性。



吳永康  
行政總裁  
王道商業銀行股份有限公司香港分行  
(於台灣註冊成立之有限公司)

