

**巴克萊銀行**  
**香港分行**

---

二零一六年  
主要財務資料披露報告

# 巴克萊銀行 香港分行

## 甲部 – 分行資料 (限於香港分行)

### 收益表

截至二零一六年十二月三十一日止年度

	附註	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
<b>持續經營業務</b>			
利息收入		89	199
利息開支		(113)	(189)
淨利息收入		<u>(24)</u>	<u>10</u>
其他經營收入	1	457	1,676
淨服務費及佣金收入	2	1,094	1,619
經營開支	3	(2,194)	(2,831)
出售物業及設備的虧損淨額		<u>(33)</u>	<u>-</u>
稅前(虧損)/盈利		<u>(700)</u>	<u>474</u>
所得稅抵免/(開支)		<u>112</u>	<u>(91)</u>
稅後(虧損)/盈利		<u>(588)</u>	<u>383</u>
已終止經營業務稅後盈利/(虧損)	4	<u>99</u>	<u>(49)</u>
本年度稅後(虧損)/盈利		<u>(489)</u>	<u>334</u>

### 資產負債表

		二零一六年 十二月三十一日 百萬港元	二零一六年 六月三十日 百萬港元
<b>資產</b>			
現金及銀行結餘		545	2,054
存放於外匯基金的數額		61	2,194
存放於海外辦事處的數額		8,634	19,434
投資證券		484	823
貸款及應收款項	5	1,382	7,704
遞延稅項資產		430	454
物業、工業裝置及設備以及投資物業		<u>101</u>	<u>157</u>
資產總額		<u>11,637</u>	<u>32,820</u>
<b>負債</b>			
客戶存款	6	1,319	11,383
結欠海外辦事處的數額		9,989	20,443
其他負債	7	<u>329</u>	<u>994</u>
負債總額		<u>11,637</u>	<u>32,820</u>

# 巴克萊銀行 香港分行

## 資產負債表外風險承擔及流動性比率 於二零一六年十二月三十一日

	二零一六年 十二月三十一日 百萬港元	二零一六年 六月三十日 百萬港元
<b>或然負債及承擔</b>		
貿易關聯或有項目	458	573
其他承擔	518	523
其他	-	893

### 衍生工具

	二零一六年十二月三十一日 百萬港元		
	公平值資產	公平值負債	合約或名義數額
匯率關聯衍生工具合約	33	25	14,844
利率衍生工具合約	-	-	-
其他	-	-	-
	<u>33</u>	<u>25</u>	<u>14,844</u>
	二零一六年六月三十日 百萬港元		
	公平值資產	公平值負債	合約或名義數額
匯率關聯衍生工具合約	550	670	92,153
利率衍生工具合約	3	3	78
其他	34	34	403
	<u>587</u>	<u>707</u>	<u>92,634</u>

上述工具的合約或名義數額顯示於結算日的交投量，並不代表所承受風險的金額。

### 流動性比率

	二零一六年 十二月三十一日	二零一五年 十二月三十一日
年度之平均流動性維持比率	95.4%	88.1%

巴克萊（“本集團”）已建立一套全面的流動性風險管理架構。此架構符合英國審慎監管局（PRA）的相關標準，旨在確保本集團維持充足數量和適當質素的資金來源。在本集團的流動性風險管理架構下，本集團已建立流動性風險可承受之水平及相關風險管理額度，並以此作為本集團釐定因其業務所產生並可承受的流動性風險及符合相關法例要求。流動性風險管理架構是通過相關政策制定，檢討和管治，分析，壓力測試，以及制定相關風險管理額度和監測措施的組合來實踐。

流動性風險可從內部壓力測試顯示出來，並以三個短期流動性壓力測試情景中預計淨合約和潛在現金流的指定百分比對流動資金池的影響來計量。

本集團採用以下三個符合PRA規定的短期流動性壓力測試情景分析：

- 市場整體受壓情景（九十日內）
- 巴克萊特定受壓情景（三十日內）
- 綜合市場和巴克萊特定受壓情景（三十日內）

本分行採用之壓力測試比流動性維持比率更為保守。相關壓力測試報告每天自動編制，並提供給本地財資部門主管以及本地和區內流動性風險管理人員檢閱。壓力測試的目標是確定潛在流動性風險的來源，並確保目前的風險敞口在指定之可承受流動性風險水平之內。

# 巴克萊銀行 香港分行

## 財務報表附註

	附註	二零一六年 百萬港元	二零一五年 百萬港元
<b>1 其他經營收入</b>			
外匯相關收入			
- 轉移定價收入		72	193
- 來自外匯交易的收益減虧損		32	16
證券相關收入			
- 轉移定價收入		472	1,073
- 來自證券交易的收益減虧損		-	8
衍生工具相關虧損/收入			
- 轉移定價(支出)/收入		(119)	386
		<u>457</u>	<u>1,676</u>
<b>2 淨服務費及佣金收入</b>			
服務費及佣金收入總計		1,202	1,850
服務費及佣金開支總計		(108)	(231)
		<u>1,094</u>	<u>1,882</u>
<b>3 經營開支</b>			
支付給關聯企業管理費		(2,118)	(2,732)
折舊		(61)	(76)
其他		(15)	(23)
		<u>(2,194)</u>	<u>(2,831)</u>
<b>4 已終止經營業務稅後盈利/(虧損)</b>			
本分行於年內已出售其財富及投資管理業務的資產及負債。是次交易為出售巴克萊集團非核心業務策略的一部分。			
交易已於二零一六年十一月二十五日完成，本分行已於收益表中確認港幣294,739,000元為是次出售已終止經營業務之稅後盈利。			
已終止經營業務之期內業績如下：			
經營收入		228	331
經營開支		(463)	(390)
稅前虧損		(235)	(59)
所得稅抵免		39	10
稅後虧損		(196)	(49)
出售已終止經營業務之稅後盈利		295	-
已終止經營業務稅後盈利/(虧損)		<u>99</u>	<u>(49)</u>
		二零一六年 十二月三十一日 百萬港元	二零一六年 六月三十日 百萬港元
<b>5 貸款及應收款項</b>			
對客戶的貸款及應收款項	8, 9, 11	829	6,607
其他應收款項			
- 應計利息及其他資產		553	1,097
		<u>1,382</u>	<u>7,704</u>
為該等貸款及應收款項於總行財務報表內確認的減值準備			
- 綜合減值準備		(5)	(8)
		<u>(5)</u>	<u>(8)</u>
有關 Barclays PLC 減值準備之準則，請參閱英文版並以此為準。			
<b>6 客戶存款</b>			
活期存款及往來賬戶		100	2,868
定期、短期通知及通知存款		1,219	8,515
		<u>1,319</u>	<u>11,383</u>
<b>7 其他負債</b>			
應計利息及其他負債		329	994
		<u>329</u>	<u>994</u>

**巴克萊銀行  
香港分行  
財務報表附註**

**8 客戶貸款及應收款項之行業類別**

	二零一六年十二月三十一日 百萬港元		二零一六年六月三十日 百萬港元		合計
	有抵押保障	無抵押保障	有抵押保障	無抵押保障	
在香港使用的貸款及應收款項	-	-	50	-	50
工業、商業及金融	1	-	3,012	776	3,788
- 物業投資	-	-	-	-	-
- 金融服務業	-	-	63	-	63
個人	-	-	1,957	-	1,957
- 購買其他住宅樓宇	-	-	-	-	-
- 其他	-	-	-	-	-
在香港以外使用的貸款及應收款項	-	828	-	749	749
對客戶的貸款及應收款項合計	1	828	5,082	1,525	6,607

**9 已逾期的客戶和銀行貸款及應收款項**

於二零一六年十二月三十一日和二零一六年六月三十日與客戶和銀行貸款及應收款項，本分行沒有任何逾期或經重組貸款。

於二零一六年十二月三十一日和二零一六年六月三十日與客戶和銀行貸款及應收款項，本分行沒有任何減值貸款。

**10 收回資產**

於二零一六年十二月三十一日和二零一六年六月三十日，本分行沒有任何收回資產。

巴克萊銀行  
香港分行  
財務報表附註

11 客戶貸款及應收款項之地區分析

	二零一六年 十二月三十一日 百萬港元	二零一六年 六月三十日 百萬港元
香港	-	3,634
中國	129	922
新加坡	-	651
澳門	699	620
其他	1	780
	<u>829</u>	<u>6,607</u>

客戶貸款及應收款項之地區分析根據交易對手的所在地，並已考慮風險轉移因素。所披露之國家佔客戶貸款及應收款項地區分析總額的10%或以上。

12 國際債權

	二零一六年十二月三十一日 百萬港元			
	銀行	非銀行之 金融機構	非金融機構之 私營機構	合計
已發展國家	9,172	-	5	9,177
當中 英國(不包括格恩西島、馬恩島和澤西)	9,071	-	2	9,073
離岸中心	391	11	716	1,118

	二零一六年六月三十日 百萬港元			
	銀行	非銀行之 金融機構	非金融機構之 私營機構	合計
已發展國家	20,621	-	505	21,126
當中 英國(不包括格恩西島、馬恩島和澤西)	19,705	-	181	19,886
離岸中心	931	779	2,733	4,443

國際債權代表所有跨境債權及以外幣結算之本地債權，並已考慮風險轉移因素。上述資料是根據金管局(BS)21 規定計算。所披露之國家佔國際債權總額的10%或以上。

13 非銀行的中國內地風險承擔

	二零一六年十二月三十一日 百萬港元			二零一六年六月三十日 百萬港元		
	資產負債表內 風險承擔	資產負債表外 風險承擔	合計	資產負債表內 風險承擔	資產負債表外 風險承擔	合計
居住在中國內地的中國公民或在中國內地註冊成立的機構及其附屬公司和合資企業	-	-	-	276	-	276
居住在中國境外的中國公民或在中國境外註冊成立的機構，而其信貸被授予在中國內地使用	129	203	332	129	129	258
其他含中國內地風險之非銀行交易對手	-	-	-	423	3	426
	<u>129</u>	<u>203</u>	<u>332</u>	<u>828</u>	<u>132</u>	<u>960</u>
撥備後資產總額	11,637			32,820		
資產負債表內風險承擔佔資產總額之百分比	1.11%			2.52%		

14 外匯風險

	二零一六年十二月三十一日 百萬港元					
	美元	人民幣	瑞士法郎	瑞典克朗	其他	合計
現貨資產	1,061	52	3	2	226	1,344
現貨負債	(1,568)	(120)	(2)	-	(225)	(1,915)
遠期買入	7,668	93	-	-	200	7,961
遠期賣出	(7,168)	(26)	-	-	(200)	(7,394)
期權淨持倉量	-	-	-	-	-	-
長(短)倉淨持倉量	<u>(7)</u>	<u>(1)</u>	<u>1</u>	<u>2</u>	<u>1</u>	<u>(4)</u>

	二零一六年六月三十日 百萬港元					
	美元	人民幣	瑞士法郎	瑞典克朗	其他	合計
現貨資產	11,181	128	77	14	3,490	14,890
現貨負債	(11,143)	(528)	(76)	(14)	(6,092)	(17,853)
遠期買入	35,625	13,085	31	-	5,837	54,578
遠期賣出	(35,663)	(12,687)	(32)	-	(3,235)	(51,617)
期權淨持倉量	-	-	-	-	-	-
長(短)倉淨持倉量	<u>-</u>	<u>(2)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>(2)</u>

# 巴克萊銀行 香港分行

乙部份 – Barclays PLC資料

集團綜合財務資料

於二零一六年十二月三十一日

	二零一六年 十二月三十一日	二零一六年 六月三十日
<b>資本充足比率 (附註一)</b>		
總資本比率	19.6%	18.7%
CET1資本比率	12.4%	11.6%

	二零一六年 十二月三十一日 百萬英鎊	二零一六年 六月三十日 百萬英鎊
<b>股東資金(不包括非控股權益)</b>	64,873	62,854

## 其他財務資料

### 資產負債表資料

總資產	1,213,126	1,351,282
總負債	1,141,761	1,281,862
總貸款及應收款項	436,035	473,443
總客戶存款	423,178	438,530

### 收益表資料

	二零一六年 百萬英鎊	二零一五年 百萬英鎊
稅前利潤	2,828	2,073

## Note

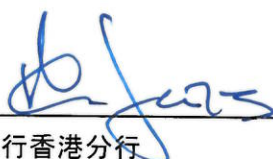
附註一 資本充足比率乃按巴塞爾委員會所制訂的指引及英國與歐洲共同體所訂立之相關條例為根據。詳情請參閱英文版並以此為準。

附註二 比較數字已被重列，以符合本年度財務資料之呈報方式。

附註三 關於Barclays PLC的財務資料詳情，請在[www.barclays.com](http://www.barclays.com)參閱Barclays PLC二零一六年年度報告。

## 行政總裁遵守聲明

謹此證實以上公布之資料符合銀行業條例15M銀行業(披露)規則，同時並無虛假或誤導成份。



巴克萊銀行香港分行

行政總裁

Anthony Miles Davies