

中信银行国际（中国）有限公司
2024 年度资本管理信息披露表

单位：人民币万元

序号	项目		余额
1	信用风险	信用风险暴露总额	2,162,003.07
		逾期贷款总额	24,066.19
		不良贷款总额	15,659.19
		贷款损失准备	26,668.98
		信用风险加权资产合计	973,502.18
2	市场风险	市场风险资本要求	2,745.89
3	操作风险	操作风险资本要求	5,438.75
4	银行账簿利率风险	1. 利率敏感性资产	1,693,801.81
		2. 利率敏感性负债	-
			1,589,293.73
		3. 衍生金融产品（不含利率期权）	2889.45
		4. 经济价值变动	
		4.1 情景 1：平行上移	10,989.05
		4.2 情景 2：平行下移	-7,168.42
		4.3 情景 3：变陡峭	27.17
		4.4 情景 4：变平缓	2,967.13
		4.5 情景 5：短期利率上升	6,534.52
4.6 情景 6：短期利率下降	-5,195.73		
5	其他信息	股权投资	无
		股权投资损益	无
		资产证券化风险暴露余额	无

注：1. 本行为非上市公司，无季度和半年度经审计的财务报告，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告为准。

2. 信用风险加权资产采用权重法计算，市场风险加权资产采用标准法计算，操作风险加权资产采用基本指标法计算，截至报告日无重大变化。

3. 信用风险资产组合为缓释后风险暴露余额，统计表内外资产和交易对手信用风险在合格缓释物缓释后结合对应权重计算的信用风险加权资产合计。