

渣打銀行(香港)有限公司

未經審核季度 監管披露

截至二零一七年三月三十一日止季度

渣打銀行(香港)有限公司

目錄

	頁碼
1 主要資本比率披露	1
2 風險加權數額概覽	2
3 在IRB計算法下信用風險承擔的風險加權數額流動表.....	3
4 在IMM計算法下市場風險承擔的風險加權數額流動表.....	3

根據《銀行業條例》第60A條的《銀行業(披露)規則》，以下為本季度所需披露的資料。

1 主要資本比率披露

	綜合	
	17年3月	16年12月
普通股權一級(「CET1」)資本比率	13.1%	13.3%
一級資本比率	14.1%	14.4%
總資本比率	17.6%	18.2%
槓桿比率	5.3%	5.2%
	百萬港元	百萬港元
資本基礎		
CET1資本	50,737	48,012
額外一級「AT1」資本	3,879	3,878
一級資本總額	54,616	51,890
二級資本	13,855	13,682
資本基礎總額	68,471	65,572
風險加權數額總額	387,992	359,971
槓桿比率風險承擔	1,033,427	1,000,195

2 風險加權數額概覽

以下列表根據風險加權數額的詳細細目分類，概述各類風險的資本規定。

	綜合 風險加權數額		最低資本規定
	17年3月 百萬港元	16年12月 百萬港元	17年3月 百萬港元
非證券化類別風險承擔的信用風險	309,769	285,776	24,782
其中STC計算法	24,108	21,943	1,929
其中BSC計算法	–	–	–
其中IRB計算法	285,661	263,833	22,853
對手方信用風險	5,354	4,583	428
其中SA-CCR計算法	–	–	–
其中現行風險承擔方法	5,354	4,583	428
其中IMM(CCR)計算法	–	–	–
使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔	–	–	–
集體投資計劃風險承擔 – LTA	–	–	–
集體投資計劃風險承擔 – MBA	–	–	–
集體投資計劃風險承擔 – FBA	–	–	–
交收風險	4	4	–
銀行帳內的證券化類別風險承擔	1,599	1,451	128
其中IRB(S)計算法 – 評級基準方法	1,599	1,451	128
其中IRB(S)計算法 – 監管公式方法	–	–	–
其中STC(S)計算法	–	–	–
市場風險	17,719	13,810	1,418
其中STM計算法	17,069	13,146	1,366
其中IMM計算法	650	664	52
業務操作風險	42,583	43,500	3,407
其中BIA計算法	–	–	–
其中STO計算法	42,583	43,500	3,407
其中ASA計算法	–	–	–
其中AMA計算法	N/A	N/A	N/A
低於扣減門檻的數額 (須計算250%風險權重)	11,492	11,491	919
資本下限調整	–	–	–
風險加權數額扣減	528	644	42
其中不包括在二級資本內的一般銀行業務風險監管儲備及 集體準備金的部分	287	403	23
其中不包括在二級資本內的土地及建築物因價值重估而產 生的累積公平價值收益的部分	241	241	19
總計	387,992	359,971	31,040

