

渣打銀行(香港)有限公司

未經審核季度 監管披露

截至二零一七年九月三十日止季度

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(OVI)	2
3 在IRB計算法下信用風險承擔的風險加權數額流動表(CR8)	4
4 在IMM計算法下市場風險承擔的風險加權數額流動表(MR2)	4

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

資本充足比率及資本基礎

	綜合 截至一七年九月三十日
普通股權一級(「CET1」)資本比率	13.5%
一級資本比率	14.5%
總資本比率	17.7%
槓桿比率	5.4%
	百萬港元
資本基礎	
CET1資本	53,734
額外一級「AT1」資本	3,878
一級資本總額	57,612
二級資本	12,640
資本基礎總額	70,252
風險加權數額總額	397,498
資本緩衝	
防護緩衝資本比率	1.3%
逆周期緩衝資本比率	0.9%
較高吸收虧損能力比率	0.8%
總資本緩衝	3.0%
槓桿比率風險承擔	1,072,065

2 風險加權數額概覽(OVI)

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。

	(a)	(b)	(c)
	綜合 風險加權數額 ¹		最低資本規定
	截至一七年 九月三十日 百萬港元	截至一七年 六月三十日 百萬港元	截至一七年 年九月三十日 百萬港元
1 非證券化類別風險承擔的信用風險	299,165	299,799	25,238
2 –其中STC計算法	27,413	24,286	2,913
2a –其中BSC計算法	–	–	–
3 –其中IRB計算法	271,752	275,513	23,045
4 對手方信用風險	7,293	6,713	601
5 –其中SA-CCR計算法	–	–	–
5a –其中現行風險承擔方法	7,293	6,713	601
6 –其中IMM(CCR)計算法	–	–	–
7 使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔	–	–	–
8 集體投資計劃風險承擔 – LTA	–	–	–
9 集體投資計劃風險承擔 – MBA	–	–	–
10 集體投資計劃風險承擔 – FBA	–	–	–
11 交收風險	–	2	–
12 銀行帳內的證券化類別風險承擔	1,387	1,480	118
13 –其中IRB(S)計算法 – 評級基準方法	1,387	1,480	118
14 –其中IRB(S)計算法 – 監管公式方法	–	–	–
15 –其中STC(S)計算法	–	–	–
16 市場風險	20,446	17,564	1,636
17 –其中STM計算法	19,787	16,913	1,583
18 –其中IMM計算法	659	651	53
19 業務操作風險	41,706	42,205	3,336
20 –其中BIA計算法	–	–	–
21 –其中STO計算法	41,706	42,205	3,336
21 –其中ASA計算法	–	–	–
22 –其中AMA計算法	不適用	不適用	不適用

2 風險加權數額概覽(OVI) (續)

	(a)	(b)	(c)
	綜合 風險加權數額 ¹		最低資本規定
	截至一七年 九月三十日 百萬港元	截至一七年 六月三十日 百萬港元	截至一七年 年九月三十日 百萬港元
23 低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重)	11,483	11,492	919
24 資本下限調整	-	-	-
24a 風險加權數額扣減	597	538	48
24b - 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	356	297	29
24c - 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
25 總計	380,883	378,717	31,800

¹ 根據香港金管局的說明，本表內的風險加權資產尚未按適用情況應用的放大系數1.06計算。

3 在IRB計算法下信用風險承擔的風險加權數額流動表(CR8)

以下列表解釋按IRB計算法斷定的信用風險的風險加權數額的改變。

	(a) 數額 百萬港元
1 上一個報告期末風險加權數額(二零一七年六月三十日)	275,513
2 資產規模	1,883
3 資產質素	(5,926)
4 模式更新	-
5 方法及政策	-
6 收購及處置	-
7 外匯變動	282
8 其他	-
9 報告期末風險加權數額(二零一七年九月三十日)	271,752

4 在IMM計算法下市場風險承擔的風險加權數額流動表(MR2)

以下列表解釋按IMM計算法斷定的市場風險的風險加權數額的變動。

	(a) 風險值 百萬港元	(b) 受壓風險值 百萬港元	(c) 遞增風險 資本要求 百萬港元	(d) 綜合風險 資本要求 百萬港元	(e) 其他 百萬港元	(f) 總計風險 加權數額 百萬港元
1 上一個報告期末風險 加權數額(二零一七年 三月三十一日)	-	-	-	-	651	651
2 風險水平變動	-	-	-	-	-	-
3 模式更新/變動	-	-	-	-	-	-
4 方法及政策	-	-	-	-	-	-
5 收購及處置	-	-	-	-	-	-
6 外匯變動	-	-	-	-	-	-
7 其他	-	-	-	-	8	8
8 報告期末風險加權數額 (二零一七年九月三十日)	-	-	-	-	659	659