

# 上海銀行（香港）有限公司

監管披露

截至二零一七年九月三十日止季度

目錄	頁數
資本比率	1
槓桿比率	2
風險加權數額概覽	2

本文件載有上海銀行(香港)有限公司(「本公司」)第三支柱披露的資本充足比率、槓桿比率、按照風險類型劃分的風險加權數額(「RWA」)。以下披露乃根據《銀行業(披露)規則》及香港金融管理局(「金管局」)頒佈的披露模板編製。本公司的資本充足比率和槓桿比率乃按非綜合基礎計算。

## 1 資本比率

資本充足比率乃根據由金管局發出《銀行業(資本)規則》計算。

	於2017年 9月30日 %	於2017年 6月30日 %	於2016年 12月31日 %
<b>資本充足比率</b>			
普通股權一級資本充足比率	24.5	24.6	30.0
一級資本充足比率	24.5	24.6	30.0
總資本充足比率	25.3	25.4	30.9
	於2017年 9月30日 港幣千元	於2017年 6月30日 港幣千元	於2016年 12月31日 港幣千元
<b>資本</b>			
普通股權一級資本	3,900,237	3,832,663	4,121,288
一級資本	3,900,237	3,832,663	4,121,288
總資本	4,024,904	3,965,931	4,249,435
<b>風險加權數額總計</b>	<b>15,923,931</b>	<b>15,609,691</b>	<b>13,733,301</b>

## 2 槓桿比率

槓桿比率乃根據由金管局發出的槓桿比率框架編製。

	於2017年 9月30日 港幣千元	於2017年 6月30日 港幣千元	於2016年 12月31日 港幣千元
一級資本	3,900,237	3,832,663	4,121,288
風險承擔	24,305,928	22,706,910	21,390,754
槓桿比率	<u>16.1</u>	<u>16.9</u>	<u>19.3</u>

## 3 風險加權數額概覽

以下圖表列出按照風險類別劃分的風險加權數額和符合由金管局規定的相應資本要求(即風險加權數額的8%)。

		風險加權數額		最低資本規定
		於2017年9 月30日 港幣千元	於2017年6 月30日 港幣千元	於2017年9 月30日 港幣千元
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	13,271,631	13,078,652	1,061,730
2	其中 STC 計算法	13,271,631	13,078,652	1,061,730
4	對手方信用風險	42,020	6,443	3,362
5a	其中現行風險承擔方法	18,682	4,080	1,495
16	市場風險	961,338	933,488	76,907
17	其中 STM 計算法	961,338	933,488	76,907
19	業務操作風險	585,188	542,713	46,815
20	其中 BIA 計算法	585,188	542,713	46,815
23	低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重)	1,063,754	1,048,395	85,100
25	總計	15,923,931	15,609,691	1,273,914

在計算風險加權數額方面，本公司採用標準(信用風險)計算法計算信用風險，及用標準(市場風險)計算法計算市場風險。而營運風險資本要求，則採用基本指標計算法計算。

受到同業定期存放於季內增加所帶動，信用風險加權數額的上升，是風險加權數額總計增加的主要原因。