



---

## 花旗銀行 (香港) 有限公司

### 第三支柱監管披露

- 資本充足比率
- 槓桿比率
- 風險加權數額概覽

截至二零一七年  
九月三十日止

本文件載有花旗銀行（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。

## 1 資本充足比率

資本充足比率乃根據金管局頒佈之《銀行業（資本）規則》計算。

以港幣千元位列示	於2017年 9月30日	於2017年 6月30日
<b>資本</b>		
普通股權第一級	20,230,416	19,688,557
第一級	20,230,416	19,688,557
總計	20,946,777	20,374,935
<b>風險加權數額總計</b>	66,883,706	64,376,092
<b>資本充足比率</b>		
普通股權一級資本比率	30.25%	30.58%
一級資本比率	30.25%	30.58%
總資本比率	31.32%	31.65%

## 2 槓桿比率

以港幣千元位列示	於2017年 9月30日	於2017年 6月30日
<b>資本及風險承擔總額</b>		
第一級資本	20,230,416	19,688,557
風險承擔總額	186,258,167	180,614,004
<b>槓桿比率</b>	10.86%	10.90%

槓桿比率乃根據由金管局發出槓桿比率框架編製。

## 模版0V1：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最低資本要求（即風險加權數額的8%）。

以港幣千元位列示		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		於2017年 9月30日	於2017年 6月30日	於2017年 9月30日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	56,713,051	54,766,767	4,537,044
2	其中STC計算法	56,713,051	54,766,767	4,537,044
4	對手方信用風險	156,153	225,211	12,492
5	其中 SA-CCR計算法 <sup>註</sup>	106,515	143,473	8,521
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔	489,347	-	39,148
15	其中STC(S)計算法	489,347	-	39,148
16	市場風險	138,050	138,150	11,044
17	其中STM計算法	138,050	138,150	11,044
19	業務操作風險	9,825,875	9,672,700	786,070
21	其中STO計算法	9,825,875	9,672,700	786,070
24a	風險加權數額扣減	438,770	426,736	35,102
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	438,770	426,736	35,102
25	<b>總計</b>	<b>66,883,706</b>	<b>64,376,092</b>	<b>5,350,696</b>

註：採用交易對手信貸風險標準計算法前，本銀行使用現行風險承擔方法計算衍生工具合約之違責風險承擔。

本公司以「標準計算法」計算信貸風險、市場風險及業務操作風險的風險加權資產。