



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

截至二零一八年
三月三十一日止

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2018年 3月31日	於2017年 12月31日
資本		
普通股權第一級	21,193,805	20,280,533
第一級	21,193,805	20,280,533
總計	21,944,414	21,027,701
風險加權數額總計	70,107,353	69,378,136
資本充足比率		
普通股權一級資本比率	30.23%	29.23%
一級資本比率	30.23%	29.23%
總資本比率	31.30%	30.31%

2 槓桿比率

以港幣千元位列示	於2018年 3月31日	於2017年 12月31日
資本及風險承擔總額		
第一級資本	21,193,805	20,280,533
風險承擔總額	199,859,344	188,925,966
槓桿比率	10.60%	10.73%

槓桿比率乃根據由金管局發出槓桿比率框架編製。

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2018年 3月31日	於2017年 12月31日	於2018年 3月31日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	59,551,724	59,223,541	4,764,138
2	其中STC計算法	59,551,724	59,223,541	4,764,138
4	對手方信用風險	120,354	107,081	9,628
5	其中SA-CCR計算法 ^註	75,966	63,056	6,077
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔	421,050	486,840	33,684
15	其中STC(S)計算法	421,050	486,840	33,684
16	市場風險	275,425	222,550	22,034
17	其中STM計算法	275,425	222,550	22,034
19	業務操作風險	9,963,850	9,817,925	797,108
21	其中STO計算法	9,963,850	9,817,925	797,108
24a	風險加權數額扣減	225,050	479,801	18,004
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	225,050	479,801	18,004
25	總計	70,107,353	69,378,136	5,608,588

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。