



花旗銀行 (香港) 有限公司

監管披露

截至二零二零年
九月三十日止

目錄

模版KM1：主要審慎比率

模版OV1：風險加權數額概覽

模版LR2：槓桿比率

模版KM1：主要審慎比率

下表列出花旗銀行（香港）有限公司（“本公司”）的主要審慎比率概覽。

		(a)	(b)	(c)	(d)	(e)
		於2020年 9月30日	於2020年 6月30日	於2020年 3月31日	於2019年 12月31日	於2019年 9月30日
以港幣千元位列示						
監管資本						
1	普通股權一級 (CET1)	23,537,475	23,638,034	22,896,852	22,079,649	22,352,471
2	一級	23,537,475	23,638,034	22,896,852	22,079,649	22,352,471
3	總資本	24,207,656	24,296,479	23,744,602	22,950,332	23,213,313
風險加權數額						
4	風險加權數額總額	93,604,858	81,802,858	79,871,940	81,630,465	80,334,315
資本充足比率						
5	普通股權一級資本比率 (%)	25.15%	28.90%	28.67%	27.05%	27.82%
6	一級資本比率 (%)	25.15%	28.90%	28.67%	27.05%	27.82%
7	總資本比率 (%)	25.86%	29.70%	29.73%	28.11%	28.90%
額外CET1緩衝要求						
8	防護緩衝資本要求 (%)	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%
9	逆周期緩衝資本要求 (%)	0.964%	0.969%	0.966%	1.921%	2.416%
10	較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於G-SIB或D-SIB)	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%	0.000%
11	認可機構特定的總CET1緩衝要求 (%)	3.464%	3.469%	3.466%	4.421%	4.916%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的CET1 (%)	17.86%	21.70%	21.73%	20.11%	20.90%
《巴塞爾協定三》槓桿比率						
13	總槓桿比率 (LR) 風險承擔計量	295,846,101	255,681,506	243,100,846	241,242,534	252,742,747
14	LR (%)	7.96%	9.25%	9.42%	9.15%	8.84%
流動性維持比率 (LMR)						
17a	LMR (%)	51.83%	52.55%	50.27%	50.52%	52.86%
核心資金比率 (CFR)						
20a	CFR (%)	146.38%	144.96%	141.25%	140.45%	143.74%

模版OV1：風險加權數額概覽

下表提供風險加權數額的詳細細目分類，以概述各類風險的資本規定。

以港幣千元位列示		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		於2020年 9月30日	於2020年 6月30日	於2020年 9月30日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	80,849,473	69,395,052	6,467,958
2	其中STC計算法	80,849,473	69,395,052	6,467,958
6	對手方違責風險及違責基金承擔	67,502	42,501	5,400
7a	其中現行風險承擔方法	67,502	42,501	5,400
10	CVA風險	51,138	34,013	4,091
16	銀行帳內的證券化類別風險承擔	357,432	344,092	28,595
18	其中SEC-ERBA計算法（包括IAA）	357,432	344,092	28,595
20	市場風險	757,063	557,225	60,565
21	其中STM計算法	757,063	557,225	60,565
24	業務操作風險	11,522,250	11,429,975	921,780
27	總計	93,604,858	81,802,858	7,488,389

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。

模版LR2：槓桿比率（“LR”）

下表列示本公司計算槓桿比率風險承擔分母的項目明細分類。

		(a)	(b)
		以港幣千元位列示	
		於2020年9月30日	於2020年6月30日
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內項目(不包括衍生工具及證券融資交易，但包括抵押品)	287,000,041	246,677,771
2	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	(341,246)	(233,778)
3	資產負債表內風險承擔總額(不包括衍生工具及證券融資交易)	286,658,795	246,443,993
衍生工具風險承擔			
4	所有與衍生工具交易有關的重置成本(即扣除合資格現金變動保證金)	35,260	29,444
5	所有與衍生工具交易有關的潛在未來風險承擔的附加數額	191,276	151,391
6	還原因提供予對手方而須根據適用會計框架從資產負債表中扣減的衍生工具抵押品的數額	-	-
7	扣減：就衍生工具交易提供的現金變動保證金的應收部分	(11,912)	(8,427)
8	扣減：中央交易對手方風險承擔中與客戶結算交易有關而獲豁免的部分	-	-
9	經調整後已出售信用衍生工具的有效名義數額	-	-
10	扣減：就已出售信用衍生工具作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減	-	-
11	衍生工具風險承擔總額	214,624	172,408
證券融資交易風險承擔			
12	經銷售會計交易調整後(在不確認淨額計算下)的證券融資交易資產總計	-	-
13	扣減：證券融資交易資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額	-	-
14	證券融資交易資產的對手方信用風險承擔	-	-
15	代理交易風險承擔	-	-
16	證券融資交易風險承擔總額	-	-
其他資產負債表外風險承擔			
17	資產負債表外風險承擔名義數額總計	82,908,105	83,517,374
18	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	(73,468,993)	(73,882,582)
19	資產負債表外項目	9,439,112	9,634,792
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	23,537,475	23,638,034
20a	為特定準備金及集體準備金作出調整前的風險承擔總額	296,312,531	256,251,193
20b	為特定準備金及集體準備金作出的調整	(466,430)	(569,687)
21	為特定準備金及集體準備金作出調整後的風險承擔總額	295,846,101	255,681,506
槓桿比率			
22	《巴塞爾協定三》槓桿比率	7.96%	9.25%