



花旗銀行 (香港) 有限公司

監管披露

截至二零二一年
九月三十日止

目錄

引言

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

引言

目的及編製基礎

本文件所載的資料為花旗銀行(香港)有限公司(“本公司”)根據《銀行業(披露)規則》及香港金融管理局(“金管局”)發出的披露範本所編制。

此監管披露受本公司經董事會批准的披露政策所規管。披露政策規定了披露文件的管治,控制和保證要求。

本文件所載資料未經審核,且不構成法定賬項。

監管披露

本公司於2021年9月30日的監管披露含有巴塞爾銀行監管委員會框架下所要求之資料。此等披露乃根據香港金管局所發出之最新的《銀行業(披露)規則》而制訂。

根據《銀行業(披露)規則》,除非標準披露模版另有指明,否則毋須披露比較資料。

模版KM1：主要審慎比率

下表列出本公司的主要審慎比率概覽。

		(a)	(b)	(c)	(d)	(e)
		於2021年 9月30日	於2021年 6月30日	於2021年 3月31日	於2020年 12月31日	於2020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)	24,632,356	23,990,902	23,683,767	23,181,354	23,537,475
2	一級	24,632,356	23,990,902	23,683,767	23,181,354	23,537,475
3	總資本	25,387,282	24,719,835	24,381,646	23,860,903	24,207,656
風險加權數額						
4	風險加權數額總額	97,267,241	96,795,323	94,890,981	94,730,301	93,604,858
資本充足比率						
5	普通股權一級資本比率 (%)	25.32%	24.79%	24.96%	24.47%	25.15%
6	一級資本比率 (%)	25.32%	24.79%	24.96%	24.47%	25.15%
7	總資本比率 (%)	26.10%	25.54%	25.69%	25.19%	25.86%
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 (%)	0.966%	0.955%	0.952%	0.957%	0.964%
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 (%)	3.466%	3.455%	3.452%	3.457%	3.464%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的CET1 (%)	18.10%	17.54%	17.69%	17.19%	17.86%
《巴塞爾協定三》槓桿比率						
13	總槓桿比率(LR)風險承擔計量	319,742,932	314,954,472	307,934,632	304,867,904	295,846,101
14	LR (%)	7.70%	7.62%	7.69%	7.60%	7.96%
流動性維持比率(LMR)						
17a	LMR (%)	49.63%	49.85%	49.80%	51.41%	51.83%
核心資金比率(CFR)						
20a	CFR (%)	148.25%	147.37%	147.12%	148.57%	146.38%

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2021年 9月30日	於2021年 6月30日	於2021年 9月30日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	84,834,549	83,498,207	6,786,764
2	其中STC計算法	84,834,549	83,498,207	6,786,764
6	對手方違責風險及違責基金承擔	107,601	138,367	8,608
7	其中SA-CCR計算法	107,601	138,367	8,608
10	CVA風險	70,175	82,100	5,614
16	銀行帳內的證券化類別風險承擔	633,240	1,030,973	50,659
18	其中SEC-ERBA計算法（包括IAA）	633,240	1,030,973	50,659
20	市場風險	631,338	774,938	50,507
21	其中STM計算法	631,338	774,938	50,507
24	業務操作風險	10,990,338	11,270,738	879,227
27	總計	97,267,241	96,795,323	7,781,379

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2021年9月30日	於2021年6月30日
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內風險承擔(不包括由衍生工具合約或證券融資交易(SFT)產生的風險承擔,但包括抵押品)	311,075,503	305,464,938
2	扣減: 斷定一級資本時所扣減的資產數額	(568,296)	(549,556)
3	資產負債表內風險承擔總額(不包括衍生工具合約及SFT)	310,507,207	304,915,382
衍生工具風險承擔			
4	所有與衍生工具合約有關的重置成本(如適用的話, 扣除合資格現金變動保證金及 / 或雙邊淨額結算)	25,059	17,780
5	所有與衍生工具合約有關的潛在未來風險承擔的附加數額	394,573	420,158
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合約抵押品的數額	-	-
7	扣減: 就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收部分	-	-
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關聯衍生工具合約的有效名義數額	-	-
10	扣減: 就已出售信用關聯衍生工具合約作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減	-	-
11	衍生工具合約產生的風險承擔總額	419,632	437,938
由SFT產生的風險承擔			
12	經銷售會計交易調整後(在不確認淨額計算下)的SFT資產總計	-	-
13	扣減: SFT資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額	-	-
14	SFT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	85,865,493	86,452,609
18	扣減: 就轉換為信貸等值數額作出的調整	(76,719,924)	(76,514,852)
19	資產負債表外項目	9,145,569	9,937,757
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	24,632,356	23,990,902
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	320,072,408	315,291,077
20b	為特定準備金及集體準備金作出的調整	(329,476)	(336,605)
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	319,742,932	314,954,472
槓桿比率			
22	槓桿比率	7.70%	7.62%

本文件為中文譯本。如中、英文本有歧義，概以英文本為準。