



**INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA (ASIA)
LIMITED**

中國工商銀行（亞洲）有限公司

（於香港註冊成立之有限公司）

有關經修訂第三支柱的披露

二零一八年第一季度

OV1：風險加權數額概覽

		貨幣：(千港元)		
		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		31/03/2018	31/12/2017	31/03/2018
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	585,521,838	544,630,670	46,841,747
2	其中 STC 計算法	585,521,838	544,630,670	46,841,747
2a	其中 BSC 計算法	-	-	-
3	其中 IRB 計算法	-	-	-
4	對手方信用風險	22,300,489	21,479,531	1,784,039
5	其中 SA-CCR 計算法	-	-	-
5a	其中現行風險承擔方法	12,093,716	12,448,495	967,497
6	其中 IMM(CCR)計算法	-	-	-
7	使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔	-	-	-
8				
9	集體投資計劃風險承擔	232,001	352,566	18,560
10				
11	交收風險	-	-	-
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔	-	-	-
13	其中 IRB(S)計算法 – 評級基準方法	-	-	-
14	其中 IRB(S)計算法 – 監管公式方法	-	-	-
15	其中 STC(S)計算法	-	-	-
16	市場風險	17,316,213	17,068,200	1,385,297
17	其中 STM 計算法	17,316,213	17,068,200	1,385,297
18	其中 IMM 計算法	-	-	-
19	業務操作風險	23,738,788	22,998,675	1,899,103
20	其中 BIA 計算法	23,738,788	22,998,675	1,899,103
21	其中 STO 計算法	-	-	-
21a	其中 ASA 計算法	-	-	-
22	其中 AMA 計算法	N/A	N/A	N/A
23	低於扣減門檻的數額 (須計算 250%風險權重)	1,148,218	1,114,768	91,857
24	資本下限調整	-	-	-
24a	風險加權數額扣減	334,512	333,155	26,761
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	-	-	-

		貨幣：(千港元)		
		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		31/03/2018	31/12/2017	31/03/2018
24c	其中不包括在二級資本內的土地及建築物因價值重估而產生的累積公平價值收益的部分	334,512	333,155	26,761
25	總計	649,923,035	607,311,255	51,993,842
N/A：不適用於香港情況				

本集團根據《銀行業（資本）規則》計算風險加權數額（RWA）。本集團之非證券化類別信用風險加權數額（含集體投資計劃及股權投資）採用標準（信用風險）計算法（STC）計算，交易對手信用風險加權數額採用現行風險承擔法（CEM）計算，市場風險之風險數額全部採用標準（市場風險）計算法（STM）計算，操作風險風險加權數額採用基本指標計算法（BIA）計算。本集團本期及上期均無交收風險、證券化信用風險之風險加權數額，無需從風險加數額扣減一般銀行業務風險監管儲備和集體準備金，亦無需經資本下限調整。

集體投資計劃風險承擔於 2018 年第 1 季度減少主要是由基金投資的重新估值所引起。其他風險加權數額隨業務情況有小幅或適度波動。

本銀行的資本充足比率及槓桿比率是按綜合基準計算。

主要資本比率披露

綜合

1. 資本充足比率

	31/03/2018 港幣千元	31/12/2017 港幣千元
普通股權一級資本	78,997,582	76,986,941
一級資本	106,738,577	84,789,320
總資本	121,982,515	100,642,230
風險加權總資產	649,923,035	607,311,255

	%	%
普通股權一級資本比率	12.15%	12.68%
一級資本比率	16.42%	13.96%
總資本比率	18.77%	16.57%

2. 槓桿比率

	31/03/2018 港幣千元	31/12/2017 港幣千元
一級資本	106,738,577	84,789,320
風險承擔計量	979,721,132	1,002,966,737

	%	%
槓桿比率	10.89%	8.45%