



**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

二零一七年第一季度

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
		31/03/2017	31/12/2016	31/03/2017
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	483,340,505	479,147,488	38,667,240
2	其中 STC 計算法	483,340,505	479,147,488	38,667,240
2a	其中 BSC 計算法	-	-	-
3	其中 IRB 計算法	-	-	-
4	對手方信用風險	15,107,597	17,835,952	1,208,608
5	其中 SA-CCR 計算法	-	-	-
5a	其中現行風險承擔方法	10,129,586	11,537,631	810,367
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	集體投資計劃風險承擔	232,001	232,001	18,560
9				
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	29,606,525	17,297,138	2,368,522
17	其中 STM 計算法	29,606,525	17,297,138	2,368,522
18	其中 IMM 計算法	-	-	-
19	業務操作風險	21,630,300	21,622,813	1,730,424
20	其中 BIA 計算法	21,630,300	21,622,813	1,730,424
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）	6,722,610	10,007,248	537,809
24	資本下限調整	-	-	-
24a	風險加權數額扣減	396,831	357,543	31,746
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
		31/03/2017	31/12/2016	31/03/2017
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	396,831	357,543	31,746
25	總計	556,242,707	545,785,097	44,499,417
N/A：不適用於香港情況				

附加說明：本集團根據《銀行業（資本）規則》計算風險加權資產（RWA）。本集團之非證券化類別信用風險加權資產（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資產採用現行風險承擔法（CEM）計算，市場風險風險資產全部採用標準（市場風險）計算法（STM）計算，操作風險風險加權資產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資產，無需從風險加資產扣減法定儲備和組合減值準備，亦無需經資本下限調整。與 2016 年底相比，2017 年 3 月 31 日的市場風險 RWA 增加約 71%，主要是由於能源類大宗商品之背對背交易量增加及外匯與港幣利率之敞口上升，分別貢獻了市場風險 RWA 變化額的 59%，15%和 10%。低於資本扣減門檻採用 250%權重的風險加權資產在本期減少的原因是被視為資本投資的對有聯係公司的風險承擔在本期減少所致。其他風險加權資產隨業務情況僅有小幅波動。

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

	31/03/2017 港幣千元	31/12/2016 港幣千元
普通股權一級資本	70,946,651	68,784,108
一級資本	78,705,695	76,527,076
總資本	94,219,318	92,828,345
風險加權總資產	556,242,707	545,785,097

	%	%
普通股權一級資本比率	12.75%	12.60%
一級資本比率	14.15%	14.02%
總資本比率	16.94%	17.01%

2. 槓桿比率

	31/03/2017 港幣千元	31/12/2016 港幣千元
一級資本	78,705,695	76,527,076
風險承擔計量	866,914,557	924,478,014

	%	%
槓桿比率	9.08%	8.28%