

上海銀行（香港）有限公司
於2016年6月30日之槓桿比率
（以港幣千元列示）

下表列示以香港金管局標準模板編製的槓桿比率披露模板及對賬摘要比較表，披露本集團槓桿比率及其風險承擔與資產負債表所列載的綜合資產之對賬。

第1部分 - 列示以香港金管局標準模板編製的槓桿比率通用披露模板，披露其主要項目明細分類。

項目	槓桿比率框架 於2016年6月30日	槓桿比率框架 於2015年12月31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)	17,739,185	15,524,094
2 扣減：斷定《巴塞爾協定三》一級資本時所扣減的資產數額(以負數表示)	(81,073)	(65,593)
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)(第1及2行相加之數)	17,658,112	15,458,501
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)	5,948	9,690
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	13,600	8,810
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(以負數表示)	-	-
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(以負數表示)	-	-
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(以負數表示)	-	-
11 衍生工具風險承擔總額(第4至10行相加之數)	19,548	18,500
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(以負數表示)	-	-
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(第12至15行相加之數)	-	-
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	2,005,829	2,250,484
18 扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整(以負數表示)	(1,538,333)	(1,774,322)
19 資產負債表外項目(第17及18行相加之數)	467,496	476,162
資本及風險承擔總額		
20 一級資本	2,501,477	2,041,456
21 風險承擔總額(第3、11、16及19行相加之數)	18,145,156	15,953,163
槓桿比率		
22 《巴塞爾協定三》槓桿比率	13.79%	12.80%

2015年12月31日至2016年6月30日，本集團的槓桿比率有所上升，主要是由於期內客戶貸款風險承擔增長所致。

第2部分 - 列示以香港金管局標準模板編製的對賬摘要比較表，披露本集團槓桿比率風險承擔與已發布財務報表所列載的綜合資產之對賬。

項目	槓桿比率框架 於2016年6月30日	槓桿比率框架 於2015年12月31日
1 已發布財務報表所列載的綜合資產總額	17,699,099	15,462,263
2 對為會計目的須作綜合計算，但在監管綜合計算範圍以外的金融實體或商業實體的投資而須作的相關調整	90,000	92,655
3 根據認可機構的適用會計框架於資產負債表內確認，但不包括在槓桿比率風險承擔計量值內的任何受信資產而須作的相關調整	-	-
4 有關衍生金融工具的調整	13,600	8,810
5 有關證券融資交易的調整(即回購交易及其他類似的有抵押借貸)	-	-
6 有關資產負債表外項目的調整(即資產負債表外風險承擔轉換為信貸等值數額)	467,496	476,162
7 其他調整	(125,039)	(86,727)
8 槓桿比率風險承擔	18,145,156	15,953,163

其他調整項目主要是按槓桿比率框架下於一級資本監管扣減的監管儲備。