HABIB BANK ZURICH (HONG KONG) LIMITED

恒比銀行蘇黎世(香港)有限公司

QUARTERLY DISCLOSURE STATEMENT

季度披露聲明書

31 March 2018

二零一八年三月三十一日

[Pursuant to Section 16C of the Banking (Disclosure) Rules issued by Hong Kong Monetary Authority]

HABIB BANK ZURICH (HONG KONG) LIMITED OVERVIEW OF RISK WEIGHTED AMOUNT AS AT 31 MARCH 2018

		(Amounts in HK\$ '000)					
		(a) (b)		(c)			
				Minimum capital requirements			
		31-Mar-2018	31-Dec-2017	31-Mar-2018			
1	Credit risk for non-securitization exposures	1,469,258	1,457,522	117,541			
2	Of which STC approach						
2a	Of which BSC approach	1,469,258	1,457,522	117,541			
3	Of which IRB approach						
4	Counterparty credit risk	178	-	14			
5	Of which SA-CCR						
5a	Of which CEM	178	-	14			
6	Of which IMM(CCR) approach						
7	Equity exposures in banking book under the market-based approach						
8	CIS exposures – LTA						
9	CIS exposures – MBA						
10	CIS exposures – FBA						
11	Settlement risk						
12	Securitization exposures in banking book						
13	Of which IRB(S) approach – ratings-based method						
14	Of which IRB(S) approach – supervisory formula method						
15	Of which STC(S) approach						
16	Market risk						
17	Of which STM approach						
18	Of which IMM approach						
19	Operational risk	181,400	180,725	14,512			
20	Of which BIA approach	181,400	180,725	14,512			
21	Of which STO approach						
21a	Of which ASA approach						
22	Of which AMA approach	N/A	N/A	N/A			
23	Amounts below the thresholds for deduction (subject to 250% RW)						
24	Capital floor adjustment						
24a	Deduction to RWA	21,167	16,307	1,694			
24b	Of which portion of regulatory reserve for general banking risks and collective provisions which is not included in Tier 2 Capital	14,983	10,123	1,199			
24c	Of which portion of cumulative fair value gains arising from the revaluation of land and buildings which is not included in Tier 2 Capital	6,184	6,184	495			
25	Total	1,629,669	1,621,940	130,373			
N/A: Not applicable in the case of Hong Kong							

Note: There were no material changes to RWA during the quarterly reporting period. Any changes were due to normal business activities.

恒比銀行蘇黎世(香港)有限公司 於2018年3月31日的銀行業披露報表 風險加權數額概覧

5 其中 SA-CCR計算法 5 其中現行風險承擔方法 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 LTA 9 集體投資計劃風險承擔 - LTA 9 集體投資計劃風險承擔 - MBA 10 集體投資計劃風險承擔 - FBA 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 - 評額基準方法 14 其中IRB(S)計算法 - 影管公式方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務條作風險 10 其中STM計算法 11 其中STO計算法 11 其中STO計算法 12 其中STO計算法 13 其中IMM計算法 14 其中IMM計算法 15 其中IMM計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務條作風險 20 其中BA計算法 21 其中STO計算法 21 其中STO計算法 21 其中STO計算法 22 其中AMA計算法 23 [依於扣減門整的數額 (須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24 風險加權數額扣減 21 16,307 1,694 24 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 14,983 10,123 1,199			(<i>E</i>)	(以港幣千元位列示)		
1			(a)	(b)	(c)	
1 非設券化類所風險平撓的信用風險 1,469,258 1,457,522 117,541 2 其中BSC計算法 1,469,258 1,457,522 117,541 3 其中BSC計算法 1,469,258 1,457,522 117,541 3 其中BSC計算法 178 - 14 5 其中受行風險承擔方法 178 - 14 5 其中回行風險承擔方法 178 - 14 5 其中回行風險承擔方法 178 - 14 5 提股資計劃風險承擔 178 - 14 5 集股股資計劃風險承擔 178 5 集中BM 6 集 集中BM 6 集 集中BM 6 集 集 集中BM 6 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集 集			風險加	風險加權數額		
2 其中SC計算法 1,469,258 1,457,522 117,541 3 其中RB計算法 1,469,258 1,457,522 117,541 4 對于方信用風險 178 - 14 5 具中 SA-CCR計算法 178 - 14 6 其中MCCR)計算法 178 - 14 6 其中IMM(CCR)計算法 178 - 14 6 其中IMM(CCR)計算法 178 - 14 6 其他MM是等的国际分法 178 - 14 7 使用市場基準計算法的銀行傾內股權風險承擔 18 - 14 9 集體投資計劃風險承擔 BBA - - 14 10 無體及計劃區除承擔 FBA -			31-Mar-2018	31-Dec-2017	31-Mar-2018	
2a 其中BSC計算法 1,469,258 1,457,522 117,541 3 其中R8計算法 178 - 14 5 其中 SA-CCR計算法 178 - 14 5 其中现代局級承擔方法 178 - 14 6 其中即MMCCR計算法 17 - 14 7 使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔 17 - 14 9 無職投資計劃風險承擔 - 14 - 4 10 集體投資計劃風險承擔 - 4 - 4 11 文收風險 2 銀行帳內的證券任期別風險承擔 2 4 - 1 -	1	非證券化類別風險承擔的信用風險	1,469,258	1,457,522	117,541	
3 其中JRB計算法 4 對手方信用風險 5 其中 SA-CCR計算法 5a 其中現行風險案掩方法 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 聚體投資計劃風險承擔 — LTA 9 聚體投資計劃風險承擔 — MBA 10 聚體投資計劃風險承擔 — FBA 交收風險 12 銀行帳內的證券化類別風險承擔 13 其中JRB(S計算法 — 幹級基準方法 14 其中RB(S計算法 — 幹級基準方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務條作風險 17 其中STM計算法 19 業務條件風險 12 其中SA計算法 10 其中SA計算法 11 其中STO計算法 11 其中TO計算法 12 其中ASA計算法 12 其中ASA計算法 13 其中MA計算法 14 其中TO計算法 15 其中DASA計算法 16 基本下限調整 17 其中TO計算法 18 其中MA計算法 19 業務條件風險 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 22 其中AMA計算法 24 其中和公計算法 24 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 24 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 24 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 24 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 25 総計 26 長期 6,184 6,184 495 26 総計	2	其中STC計算法				
178	2a	其中BSC計算法	1,469,258	1,457,522	117,541	
5 其中 SA-CCR計算法 178 - 14 6 其中IMM(CCR)計算法 7 使用市場基準計算法的銀行帳内股權風險承擔 2 14 2 月 2 14 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 1 1 1 2 2 2 2 1 2 2 2 2 1 2 2 2 1 2 2 2 1 2 2 1 2 2 1 2 2 1 2 1 1 2 2 1 1 2 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 1 1 2 2 1 1 1 2 1	3	其中IRB計算法				
5a 其中現戶風險承擔方法 178 - 14 6 其中IMM(CCR)計算法 / <t< td=""><td>4</td><td>對手方信用風險</td><td>178</td><td>-</td><td>14</td></t<>	4	對手方信用風險	178	-	14	
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 — LTA 9 集體投資計劃風險承擔 — MBA 10 集學投資計劃風險承擔 — FBA 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 — 監管公式方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 10 集學B科計算法 10 其中BA計算法 11 其中STO計算法 12 其中STO計算法 13 其中IMM計算法 14 其中IMM計算法 15 其中STM計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 21 其中STO計算法 21 其中STO計算法 21 其中STO計算法 22 其中AMA計算法 23 抵於打政門整的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24 風險加權數額扣減 24 資本下限調整 24 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全的部分 24 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 25 總計 26 1,621,940 130,373	5	其中 SA-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 — LTA 9 集體投資計劃風險承擔 — MBA 10 集體投資計劃風險承擔 — FBA 11 交收風險 12 銀行帳內的證券化類別風險承擔 13 其中RB(S)計算法 — 評修公式方法 14 其中RB(S)計算法 — 監管公式方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 19 業務操作風險 181,400 18 其中IMM計算法 180,725 14,512 20 其中STO計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A N/A 23 低於和減門艦的數額(須計算250%風險權重) 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 24c 其中不包括在二級資本內的土地及建築物房價值重估而產生的累積公平 6,184 6,184 495 25 總計 <td< td=""><td>5a</td><td>其中現行風險承擔方法</td><td>178</td><td>-</td><td>14</td></td<>	5a	其中現行風險承擔方法	178	-	14	
# 集體投資計劃風險承擔 - LTA	6	其中IMM(CCR)計算法				
9 集體投資計劃風險承擔 - MBA 10 集體投資計劃風險承擔 - FBA 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 - 監管公式方法 14 其中STC(S)計算法 - 監管公式方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 20 其中BIA計算法 180,725 21 其中STO計算法 21 其中ASA計算法 N/A 22 其中AMA計算法 N/A 23 低於和減門權的數額(須計算250%風險權重) N/A 24 資本下限調整 21,167 16,307 24 國、鼠險加權數額扣減 21,167 16,307 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 14,983 10,123 1,199 24c 費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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	7	使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔				
10 集體投資計劃風險承擔 - FBA 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STC(S)計算法 - 監管公式方法 15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 21 其中STO計算法 22 其中AMA計算法 22 其中AMA計算法 23 低於扣減門權的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 24c 價值收益的部分 25 總計 6,184 6,184 495	8	集體投資計劃風險承擔 — LTA				
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 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 181,400 180,725 14,512 21a 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A 23 低於打滅門艦的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24a 風險加權數額刊減 21,167 16,307 1,694 24b 其中不包括在二級資本内的一般銀行業務風險監管儲備及集體準備金的部分 14,983 10,123 1,199 24c 其中不包括在二級資本内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 6,184 6,184 495 25 總計 1,621,940 130,373	9	集體投資計劃風險承擔 — MBA				
12 銀行帳內的證券化類別風險承擔 其中IRB(S)計算法 - 評級基準方法 其中IRB(S)計算法 - 監管公式方法 其中STC(S)計算法 監管公式方法 其中STM計算法 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 18 其中IMM計算法 181,400 180,725 14,512 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 19 其中STO計算法 181,400 180,725 14,512 19 其中STO計算法 19 其中STO計算法 19 其中STO計算法 19 其中ASA計算法 181,400 180,725 14,512 19 其中不AMA計算法 19 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 14,983 10,123 1,199 14,983 14,9	10	集體投資計劃風險承擔 — FBA				
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 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 180,725 14,512 21a 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A 23 低於扣減門艦的數額 (須計算250%風險權重) 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,621,940 130,373	11	交收風險				
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 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 21 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A N/A 23 低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重) 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	12	銀行帳內的證券化類別風險承擔				
15 其中STC(S)計算法 16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A 23 低於扣減門艦的數額(須計算250%風險權重) 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	13	其中IRB(S)計算法 - 評級基準方法				
16 市場風險 17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 21 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 23 低於扣減門艦的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24 國險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	14	其中IRB(S)計算法 - 監管公式方法				
17 其中STM計算法 18 其中IMM計算法 181,400 180,725 14,512 19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中ASA計算法 N/A N	15	其中STC(S)計算法				
18其中IMM計算法181,400180,72514,51219業務操作風險181,400180,72514,51220其中BIA計算法181,400180,72514,51221其中STO計算法N/AN/AN/A22其中AMA計算法N/AN/AN/A23低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重)24資本下限調整21,16716,3071,69424a風險加權數額扣減21,16716,3071,69424b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14,98310,1231,19924c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6,1846,18449525總計1,621,940130,373	16	市場風險				
19 業務操作風險 181,400 180,725 14,512 20 其中BIA計算法 181,400 180,725 14,512 21 其中STO計算法 21 其中ASA計算法 N/A N/A N/A N/A 23 低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 21,167 16,307 1,694 24 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	17	其中STM計算法				
20其中BIA計算法181,400180,72514,51221其中STO計算法21a其中ASA計算法N/AN/AN/A22其中AMA計算法N/AN/AN/A23低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重)24a至1,16716,3071,69424a風險加權數額扣減21,16716,3071,69424b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14,98310,1231,19924c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6,1846,18449525總計1,629,6691,621,940130,373	18	其中IMM計算法				
21 其中STO計算法 21a 其中ASA計算法 22 其中AMA計算法 23 低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24a 風險加權數額扣減 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 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 25 總計 6,184 6,184 495 25 總計	19	業務操作風險	181,400	180,725	14,512	
21a 其中ASA計算法 N/A N/A N/A 22 其中AMA計算法 N/A N/A N/A 23 低於扣減門艦的數額(須計算250%風險權重) 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	20	其中BIA計算法	181,400	180,725	14,512	
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) 24 資本下限調整 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	21	其中STO計算法				
23 低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重) 24 資本下限調整 24 資本下限調整 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	21a	其中ASA計算法				
24 資本下限調整 21,167 16,307 1,694 24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	22	其中AMA計算法	N/A	N/A	N/A	
24a 風險加權數額扣減 21,167 16,307 1,694 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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	23	低於扣減門檻的數額(須計算250%風險權重)				
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 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	24	資本下限調整				
24b 部分 14,983 10,123 1,199 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 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	24a	風險加權數額扣減	21,167	16,307	1,694	
24c 價值收益的部分 6,184 6,184 495 25 總計 1,629,669 1,621,940 130,373	24b		14,983	10,123	1,199	
	24c		6,184	6,184	495	
N/A:不適用於香港情況	25	總計	1,629,669	1,621,940	130,373	

附註:風險加權數額於此季度報告期內沒有重大變化。 所有變化都是基於正常業務。