



上海商業銀行
SHANGHAI COMMERCIAL BANK

逆週期緩衝資本 (CCyB) 比率

於2016年12月31日



融合 傳承 創新

上海商業銀行有限公司

(除另註明外，所有金額以港幣千元編製)

逆週期緩衝資本 (CCyB) 比率

本銀行之 CCyB 比率是根據加權平均計算本銀行有私人機構信貸風險承擔的所有地區 (包括香港) 當時生效的適用地區逆週期緩衝資本 (JCCyB) 比率釐定。配予某地區的適用 CCyB 比率的權重是本銀行在該地區 (風險承擔的地理位置盡可能以最終風險的原則決定) 的私人機構信貸風險承擔 (包括其銀行賬及交易賬內的信用風險承擔) 的合計風險加權數額 (RWA) 佔本銀行對私人機構信貸風險承擔的所有地區的該等合計風險加權數額的總和的比例。

風險承擔變化的主要驅動因素包括資產質量、信貸增長和信貸組合。香港之 JCCyB 比率由香港金融管理局 (「金管局」) 根據具有透明度的「初始參考計算值」 (Initial Reference Calculator) 計算並會予以公開。如金管局決定並公布實施較高或較低於香港境外之地區的 JCCyB 比率，該比率可能會和由該地區有關當局決定的 JCCyB 比率不同。

下列表格顯示於 2016 年 12 月 31 日有關 CCyB 比率、私人機構信用風險承擔的 RWA 按地區分類及其相應的 JCCyB 比率。

司法管轄區	當日有效的適用 JCCyB 比率	計算認可機構的 CCyB 比率所用的 RWA 總額	認可機構的 CCyB 比率	認可機構的 CCyB 數額
	%	港幣千元	%	港幣千元
1 香港	0.625%	44,959,418		
2 中國內地	0.000%	4,321,643		
3 澳洲	0.000%	6,778		
4 比利時	0.000%	436		
5 百慕大	0.000%	576,497		
6 巴西	0.000%	26		
7 柬埔寨	0.000%	246		
8 加拿大	0.000%	45,323		
9 開曼群島	0.000%	1,137,553		
10 智利	0.000%	70		
11 多明尼加共和國	0.000%	17		
12 芬蘭	0.000%	474		
13 法國	0.000%	14,890		
14 德國	0.000%	330		
15 印度	0.000%	1,162		
16 印度尼西亞	0.000%	2,394		
17 意大利	0.000%	2,577		
18 日本	0.000%	107,161		
19 澳門	0.000%	50,256		
20 馬達加斯加	0.000%	1,490		
21 馬來西亞	0.000%	7		
22 新西蘭	0.000%	33,435		
23 菲律賓	0.000%	2,208		
24 葡萄牙	0.000%	85		
25 新加坡	0.000%	17,022		
26 南非	0.000%	2,722		
27 韓國	0.000%	3		
28 瑞典	1.500%	99		
29 瑞士	0.000%	817		
30 中華台北	0.000%	1,141,279		
31 泰國	0.000%	10,702		
32 英國	0.000%	427,172		
33 美國	0.000%	17,734,240		
34 西印度群島(英國)	0.000%	2,676,320		
總額		73,274,852	0.38%	280,997