



KEB HANA GLOBAL FINANCE LIMITED

換銀韓亞環球財務有限公司

季度披露報表

截至 2017 年 9 月 30 日

KEB HANA GLOBAL FINANCE LIMITED  
換銀韓亞環球財務有限公司

目錄

|                 | 頁 |
|-----------------|---|
| 公司資料及編製基準       | 3 |
| <hr/>           |   |
| 未經審核銀行業披露報表     |   |
| 資本比率            |   |
| 表 1: 資本比率       | 4 |
| 槓桿比率            |   |
| 表 2: 槓桿比率       | 4 |
| 風險加權數額          |   |
| 表 OV1: 風險加權數額概覽 | 5 |

## KEB HANA GLOBAL FINANCE LIMITED

換銀韓亞環球財務有限公司

### 公司資料

換銀韓亞環球財務有限公司（“本公司”）為一間於香港成立的有限公司。其直接控股公司為於大韓民國註冊成立的有限公司 KEB Hana Bank（“母銀行”），而其最終控股公司為 Hana Financial Group Inc.。本公司之註冊及辦事處地址是香港灣仔告士打道 108 號光大中心 29 樓 2905-2910 室。

本公司乃根據香港銀行業條例註冊成立之接受存款公司及根據證券及期貨條例註冊成立之機構。本公司主要業務包括商業貸款、接受存款及證券買賣。在此期間，本公司之主要業務沒有顯著改變。

### 編製基準

本季度披露報表乃根據並全面遵從由香港金融管理局（“金管局”）所發出之《銀行業(披露)規則》內所載之規定而編製。

資本充足比率乃按照香港金融管理局發出之《銀行業(資本)規則》（“資本規則”）而計算。根據資本規則，本公司選擇採納「基本計算法」計算信貸風險及採用「基本指示模式計算法」計算營運風險。本公司就《銀行業(資本)規則》第 22(1)款已獲得第 17 款市場風險的計算豁免。

KEB HANA GLOBAL FINANCE LIMITED  
換銀韓亞環球財務有限公司

未經審核之資料

資本比率

資本充足比率乃按照香港金融管理局發出之《銀行業(資本)規則》(“資本規則”)而計算。根據資本規則，本公司選擇採納「基本計算法」計算信貸風險及採用「基本指示模式計算法」計算營運風險。本公司就銀行業(資本)規則第22(1)款已獲得第17款市場風險的計算豁免。

表 1: 資本比率

|            | 註         | 30/9/2017<br>美元 |
|------------|-----------|-----------------|
| 普通股權一級資本   | [A]       | 55,246,012      |
| AT1 資本     |           | -               |
| 一級資本       | [B]       | 55,246,012      |
| 二級資本       |           | 1,252,721       |
| 總資本        | [C]       | 56,498,733      |
| 風險加權資產總額   | [D]       | 111,005,634     |
| 普通股權一級資本比率 | [A] / [D] | 49.77%          |
| 一級資本比率     | [B] / [D] | 49.77%          |
| 總資本比率      | [C] / [D] | 50.90%          |

槓桿比率

槓桿比率(“LR”)根據由香港金融管理局發出填報指示而計算。

表 2: 槓桿比率

|        | 註         | 30/9/2017<br>美元 |
|--------|-----------|-----------------|
| 一級資本   | [B]       | 55,246,012      |
| 風險承擔總額 | [E]       | 185,604,960     |
| 槓桿比率   | [B] / [E] | 29.77%          |

KEB HANA GLOBAL FINANCE LIMITED  
 換銀韓亞環球財務有限公司

未經審核之資料

風險加權數額概覽

使用金管局指定的標準模板，下表藉提供風險加權數額的詳細細目分類，概述各類風險的資本規定。最低資本規定代表按風險加權數額的 8%計算的資本金額。

於2017年9月30日

表 OV1: 風險加權數額概覽

|     |  | (a)         | (b)         | (c)       |
|-----|--|-------------|-------------|-----------|
|     |  | 風險加權數額      |             | 最低資本規定    |
|     |  | 30/9/2017   | 30/6/2017   | 30/9/2017 |
|     |  | 美元          | 美元          | 美元        |
| 1   | 非證券化類別風險承擔的信用風險                        | 100,217,720 | 96,036,880  | 8,017,418 |
| 2   | 其中 STC 計算法                             |             |             |           |
| 2a  | 其中 BSC 計算法                             | 100,217,720 | 96,036,880  | 8,017,418 |
| 3   | 其中 IRB 計算法                             |             |             |           |
| 4   | 對手方信用風險                                | -           | -           | -         |
| 5   | 其中 SA-CCR 計算法                          |             |             |           |
| 5a  | 其中現行風險承擔方法                             |             |             |           |
| 6   | 其中 IMM(CCR) 計算法                        |             |             |           |
| 7   | 銀行帳內的證券化類別風險承擔                         | -           | -           | -         |
| 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 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                                 | 11,373,773  | 11,606,845  | 909,902   |
| 20  | 其中 BIA 計算法                             | 11,373,773  | 11,606,845  | 909,902   |
| 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)              | -           | -           | -         |
| 24  | 資本下限調整                                 | -           | -           | -         |
| 24a | 風險加權數額扣減                               | 585,859     | 424,433     | 46,869    |
| 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      | 585,859     | 424,433     | 46,869    |
| 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                                     | 111,005,634 | 107,219,292 | 8,880,451 |

N/A: 不適用於香港情況

本季度總風險加權資產增加主要是由於非證券化風險增加。