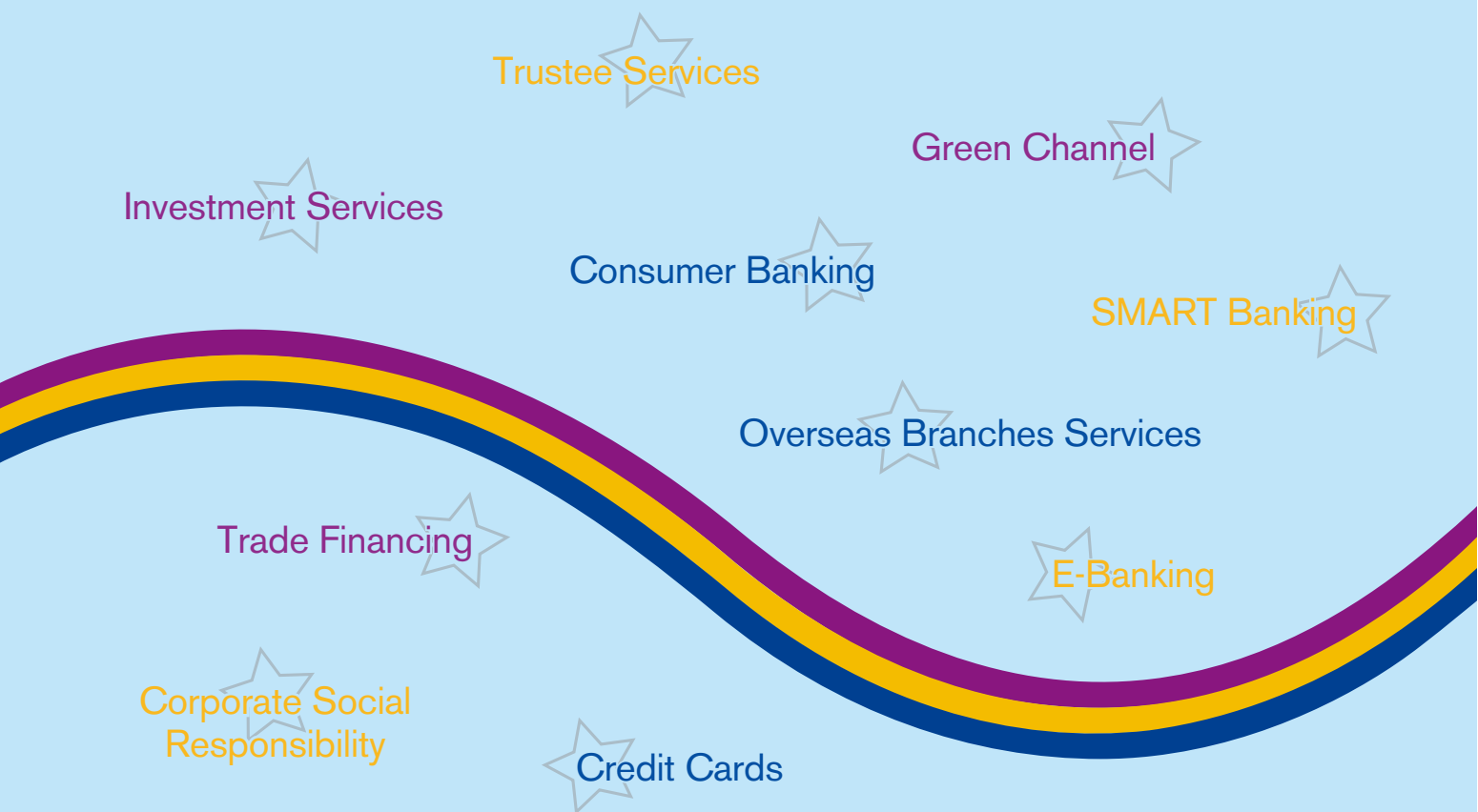




上海商業銀行
SHANGHAI COMMERCIAL BANK

槓桿比率

於2015年6月30日



槓桿比率

槓桿比率按與綜合資本充足比率相同的監管綜合計算範圍計算。下列表格顯示於2015年6月30日及2014年12月31日的對賬摘要比較表：

| 項目 | 槓桿比率框架 | |
|---|--------------------|-------------|
| | 2015年6月30日 | 2014年12月31日 |
| 1 已發布財務報表所列載的綜合資產總額 | 161,458,153 | 152,468,513 |
| 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業實體或商業實體的投資而須作的相關調整 | (243,950) | (148,632) |
| 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 | 302,861 | 154,172 |
| 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) | 7,751,309 | 15,345,784 |
| 7 其他調整 | (1,781,874) | (1,353,732) |
| 8 槓桿比率風險承擔 | 167,486,499 | 166,466,105 |

於2015年6月30日及2014年12月31日的槓桿比率通用披露模版如下：

| 項目 | 槓桿比率框架 | |
|--|--------------------|-------------|
| | 2015年6月30日 | 2014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) | 161,361,405 | 152,479,550 |
| 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) | (2,043,414) | (1,615,644) |
| 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) | 159,317,991 | 150,863,906 |
| 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) | 114,338 | 102,243 |
| 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 | 302,861 | 154,172 |
| 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) | 417,199 | 256,415 |

槓桿比率 (續)

| 項目 | | 槓桿比率框架 | |
|---------------------|---------------------------------------|---------------------|--------------|
| | | 2015年6月30日 | 2014年12月31日 |
| 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 | 40,171,423 | 45,057,231 |
| 18 | 扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整 (以負數表示) | (32,420,114) | (29,711,447) |
| 19 | 資產負債表外項目 (第 17 及 18 行相加之數) | 7,751,309 | 15,345,784 |
| 資本及風險承擔總額 | | | |
| 20 | 一級資本 | 19,891,970 | 19,832,199 |
| 21 | 風險承擔總額 (第 3、11、16 及 19 行相加之數) | 167,486,499 | 166,466,105 |
| 槓桿比率 | | | |
| 22 | 巴塞爾協定三槓桿比率 | 11.88% | 11.91% |