

# 華僑永亨銀行有限公司

於2017年12月31日其他披露

(以港幣千元列示，另註除外)

模版CCR1：按計算法劃分的對手方違責風險的風險承擔（對中央交易對手方的風險承擔除外）

|    |                      | (a)       | (b)       | (c)       | (d)                     | (e)                      | (f)       |
|----|----------------------|-----------|-----------|-----------|-------------------------|--------------------------|-----------|
|    |                      | 重置成本      | 潛在未來風險承擔  | 有效預期正風險承擔 | 用作計算違責風險的風險承擔的 $\alpha$ | 已將減低信用風險措施計算在內的違責風險的風險承擔 | 風險加權數額    |
| 1  | SA-CCR 計算法（對於衍生工具合約） | 2,996,737 | 2,843,259 |           | -                       | 5,551,966                | 3,153,457 |
| 1a | 現行風險承擔方法             | 2,996,737 | 2,843,259 |           | -                       | 5,551,966                | 3,153,457 |
| 2  | IMM (CCR) 計算法        |           |           | -         | -                       | -                        | -         |
| 3  | 簡易方法（對於證券融資交易）       |           |           |           |                         | -                        | -         |
| 4  | 全面方法（對於證券融資交易）       |           |           |           |                         | 426,470                  | 102,598   |
| 5  | 風險值（對於證券融資交易）        |           |           |           |                         | -                        | -         |
| 6  | 總計                   | 2,996,737 | 2,843,259 | -         | -                       | 5,978,436                | 3,256,055 |