



瑞士银行（中国）有限公司
北京市西城区金融大街7号
英蓝国际金融中心 1220B-1230
单元邮编：100033
电话：+8610-5832 7000
传真：+8610-5832 7171
www.ubs.com

瑞士银行（中国）有限公司 2024年第三季度资本管理第三支柱信息披露

根据国家金融监督管理总局令 2023 年第 4 号公布的《商业银行资本管理办法》的有关要求，瑞士银行（中国）有限公司（以下简称“我行”）披露关键审慎监管指标如下：

表格 KM1：监管并表关键审慎监管指标¹

单位：人民币万元，百分比除外	2024年3季度 (未经审计)	2024年2季度 (未经审计)	2024年1季度 (未经审计)	2023年4季度 (未经审计)	2023年3季度 (未经审计)
可用资本（数额）					
1 核心一级资本净额	93,078.50	97,809.12	102,141.19	105,978.07	111,835.34
2 一级资本净额	93,078.50	97,809.12	102,141.19	105,978.07	111,835.34
3 资本净额	93,090.75	97,829.08	102,168.23	106,080.48	111,905.45
风险加权资产（数额）					
4 风险加权资产	51,657.75	67,245.71	68,512.26	35,499.81	56,550.48
资本充足率					
5 核心一级资本充足率（%）	180.18	145.45	149.08	298.53	197.76
6 一级资本充足率（%）	180.18	145.45	149.08	298.53	197.76
7 资本充足率（%）	180.21	145.48	149.12	298.82	197.89
其他各级资本要求					
8 储备资本要求（%）	2.50	2.50	2.50	2.50	2.50
9 逆周期资本要求（%）	-	-	-	-	-

单位：人民币万元，百分比除外		2024年3季度 (未经审计)	2024年2季度 (未经审计)	2024年1季度 (未经审计)	2023年4季度 (未经审计)	2023年3季度 (未经审计)
10	全球系统重要性银行或国内系统重要性银行附加资本要求 (%)					
11	满足最低资本要求后的可用核心					
12	一级资本净额占风险加权资产的比例 (%)	172.21	137.48	141.12	290.82	189.89
杠杆率³						
13	调整后表内外资产余额	174,325.14	182,506.62	188,648.34	173,234.77	182,669.64
14	杠杆率 (%)	53.39	53.59	54.14	61.18	61.22
14a	杠杆率 a (%)	53.39	53.59	54.14	61.18	61.22
流动性覆盖率²						
15	合格优质流动性资产					
16	现金净流出量					
17	流动性覆盖率 (%)					
净稳定资金比例²						
18	可用稳定资金合计					
19	所需稳定资金合计					
20	净稳定资金比例 (%)					
流动性比例³						
21	流动性比例 (%)	924.54	904.19	1,573.13	1,135.94	999.31

注：

1. 根据金规【2023】9号国家金融监督管理总局关于实施《商业银行资本管理办法》相关事项通知，对第二档银行中非上市银行设置5年的信息披露过渡期。过渡期内应至少披露《附件22：商业银行信息披露内容和要求》第七部分“非国内系统重要性银行披露概览”全套表格中的2张，包括监管并表关键审慎监管指标（KM1）和资本构成（CC1）表格。其中，监管并表关键审慎监管指标（KM1）表格按季度披露，资本构成（CC1）表格按半年度披露。另，根据金规【2023】9号国家金融监督管理总局关于实施《商业银行资本管理办法》相关事项的通知，商业银行首次进行信息披露时，对监管并表关键审慎监管指标（KM1）可仅披露当期数据，无需追溯披露前期数据，但应从第二次披露起逐期追溯并披露前期数据。
2. 根据国家金融监督管理总局2018年第3号文《商业银行流动性风险管理办法》规定，资产规模小于2000亿元的商业银行适用优质流动性资产充足率、流动性比例和流动性匹配率。流动性覆盖率和净稳定资金比例适用于资产规模在2000亿元（含）以上的商业银行，我行资产规模未达2000亿元（含）以上，因此不适用。
3. 本季末流动性比例较上季上升20.35%，主要由于流动性资产余额较上季有所增加，由一个月内到期的同业往来款项轧差后资产方净额的增加所致，并非监管制度、集团架构或业务模式的变化引起指标下降。我行流动性比例、优质流动性资产充足率和流动性匹配率均满足且优于监管要求，并维持较高的流动性储备水平，流动性风险处于安全可控的范围内。其他关键审慎监管指标较上季度无重大变化，各项审慎监管指标在各期均满足且优于监管要求。另，根据相关填报要求，由于我行未提交临时豁免存款准备金的相关申请，因此杠杆率在14项下披露为考虑临时豁免存款准备金的杠杆率，与14a不考虑临时豁免存款准备金的杠杆率项保持一致。