The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 香港上海滙豐銀行有限公司

於2021年3月31日之監管規定資本票據及非資本吸收虧損能力債務票據 之主要特點 (未經審核)



目錄	\$:				
第(第(i)部分 僅監管資本(但非吸收虧損能力)要求				
1	主資本無定期浮息票據(4億美元)	5			
第(i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求				
2	普通股	6			
3	永久後償貸款(10億美元)	6			
4	永久後償貸款(9億美元)	7			
5	永久後償貸款(5億美元)	7			
6	永久後償貸款(6億美元)	8			
7	永久後償貸款(7億美元)	8			
8	永久後償貸款(9億美元)	9			
9	永久後償貸款(11億美元)	9			
10	2031年到期後償貸款(6億美元)	10			
11	2030年到期後償貸款(10億美元)	10			
12	2030年到期後償貸款(1.8億美元)	11			
第(ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求				
13	2022年到期後償貸款(5.7億美元)	12			
14	2024年到期後償貸款(5.75億美元)	12			
15	2027年到期後償貸款(6.3億美元)	13			
16	2028年到期後償貸款(7.25億美元)	13			
17	2024年到期後償貸款(6.5億澳元)	14			
18	2024年到期後償貸款(3.5億澳元)	14			
19	2023年到期後償貸款(17.5億美元)	15			
20	2028年到期後償貸款(17.5億美元)	15			
21	2023年到期後償貸款(10億美元)	16			
22	2024年到期後償貸款(20億美元)	16			
23	2029年到期後償貸款(30億美元)	17			
24	2024年到期後償貸款(793億日圓)	17			
25	2026年到期後償貸款(131億日圓)	18			
26	2028年到期後償貸款(676億日圓)	18			
27	2036年到期後償貸款(20億美元)	19			
28	2026年到期後償貸款(25億美元)	19			
	註釋	20			

若干界定用語

在本文件內,中華人民共和國香港特別行政區簡稱為「香港」。「百萬」指數以百萬計的相關貨幣。 本文件中英文本如有歧異,概以英文本為準。

免責聲明

本文件為披露文件‧乃為說明香港上海滙豐銀行有限公司的資本票據及非資本吸收虧損能力(「LAC」)票據的主要特點而發布。

本文件所載資料乃根據香港金融管理局(「香港金管局」)《銀行業(資本)規則》(「《資本規則》」)及《金融機構(處置機制)(吸收虧損能力規定——銀行界)規則》(「《吸收虧 損能力規則》」)編製。

披露採用規定格式·因此本文件所述資本票據的特點有所簡化及縮略。本文件所載資料無意作為相關資本票據的全面說明。此類資本票據的投資者或有意投資者不應倚賴本文件所載說明;滙 豐不會因本文件所含的不準確之處或錯誤陳述而承擔任何責任。

香港上海滙豐銀行有限公司發行的資本票據均由HSBC Asia Holdings Limited持有 · 唯主資本無定期浮息票據除外 · 此乃由外界投資者持有 · 本文件所載資本票據的相關資料不應 作為投資建議 · 並不構成任何此類資本票據的出售要約或購買要約招攬 · 亦非有關任何此類資本票據的建議或推薦 · 作出投資決策時 · 應尋求專業財務顧問的意見 ·

1) 主資本無定期浮息票據(4億美元)

1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司
	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	GB0004355490
	票據的管限法律	英格蘭法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用
	監管處理方法	
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	二級
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不可計入
	可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	單獨及集團
a	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 (就吸收虧損能力目的) 要據應以上的名式結整原作用)	不適用
	票據類別(由各司法管轄區指明)	永久債務票據
_	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	3,109百萬港元
а	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期) 	不適用
_	票據面值	4億美元 名法 概念/
0	會計分類	負債──攤銷成本
1	最初發行日期	1986年7月9日
2	永久性或設定期限	永久
3	原訂到期日	-
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於1991年7月9日 / 發生稅務事件的任何時間 按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息	
7	固定或浮動股息 / 票息	浮動
8	票息率及任何相關指數	(如無法獲得倫敦銀行同業中間息率)3個月 元倫敦銀行同業拆息+0.1875厘
9	有停止派發股息的機制	沒有
0	全部酌情、部分酌情·或強制	部分酌情
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有
2	非累計或累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換
4	若可轉換.轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力— 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換・全部或部分	可全部或部分轉換
6	石の時後・轉換比率	[須待轉換時釐定
0 7	若可轉換,強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換,指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
9	若可轉換.指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇 減特點	有
1	若撇減・撇減觸發事件	觸發《處置機制條例》下之法定內部財務重整 權力
2	若撇減·全部或部分	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	永久
4	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用
4a	後償類別	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	
6	可過渡的不合規特點	有
。 7	如是,指明不合規特點	不 未設無法持續營運時彌補虧損條款。
	條款與細則	<i>條款與細則 — 資本票據1³</i>

第(i	ii)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	2) 普通股	3) 永久後償貸款(10億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
3	票據的管限法律	香港法律	香港法律
Ba	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據) 監管處理方法	不適用	不適用
1	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
5	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	普通股權一級	額外一級
6	可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	單獨及集團	單獨及集團
6a	可計入單獨 / 吸收虧損能力綜合集團 / 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 (就吸收虧損能 力目的)	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
7	票據類別(由各司法管轄區指明)	普通股	永久債務票據
3	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	170,881百萬港元	7,834百萬港元
Ba	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	170,881百萬港元	7,834百萬港元
)	票據面值	零面值(總額1,723.35億港元)	10億美元
10	會計分類	股東權益	股東權益
11	最初發行日期	多個	2019年6月18日
12	永久性或設定期限	永久	永久
13	原訂到期日	不適用	不適用
14	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	不適用	
15	可選擇贖回日、或有贖回日,以及贖回價	不適用	可於 2025 年3月30日按面值贖回
16	後續贖回日(如適用)	不適用	首個贖回日之後的每個付息日
10	三、 · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·		日间度口口之反的马回门心口
17		不適用	固定至浮動
17			
10	票息率及任何相關指數	不適用	由2025年3月30日起·分派率由固定的6.09厘 為3個月倫敦銀行同業拆息+4.08厘
19	有停止派發股息的機制	不適用	沒有
20	全部酌情、部分酌情·或強制	全部酌情	全部酌情
21	設有遞升息率或其他贖回誘因	不適用	沒有
22	非累計或累計	非累計	非累計
23	可轉換或不可轉換	不可轉換	可轉換
24	若可轉換・轉換觸發事件	不適用	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
25	若可轉換·全部或部分	不適用	可全部或部分轉換
26	若可轉換.轉換比率	不適用	須待轉換時釐定
27	若可轉換.強制或可選擇性轉換	不適用	若干條件達致後為強制性轉換
28	若可轉換·指明轉換後的票據類別	不適用	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
29	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	不適用	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
30	撇減特點	不適用	有
31	若撇減・撇減觸發事件	不適用	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力
32	若撇減・全部或部分	不適用	可部分撇減
33	若撇減・永久或臨時性質	不適用	永久
34	若屬臨時撇減・說明回復機制	不適用	不適用
34a		合約性	合約性
35			緊接二級資本票據之後
36	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
51	如是·指明不合規特點	不適用	不適用

37	如是,指明不合規特點	不適用	不適用
	條款與細則	條款與細則 - 資本票據2 ³	條款與細則 - 資本票據33

第(i	i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	4) 永久後償貸款(9億美元)	5) 永久後償貸款(5億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法 (適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	額外一級	額外一級
	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	單獨及集團	單獨及集團
à	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)		單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	永久債務票據	永久債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	7,063百萬港元	3,905百萬港元
a	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	7,063百萬港元	3,905百萬港元
	票據面值	9億美元	5億美元
)	會計分類	股東權益	股東權益
	最初發行日期	2019年5月30日	2019年6月21日
2	永久性或設定期限	永久	永久
3	原訂到期日	不適用	不適用
1	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2026年9月28日按面值贖回	可於2025年3月30日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	由2026年9月28日起·分派率由固定的6.51厘改 為3個月倫敦銀行同業拆息+4.25厘	1 由2025年3月30日起·分派率由固定的6.172 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.23厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
0	全部酌情、部分酌情·或強制	全部酌情	全部酌情
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	非累計	非累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換・轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下: 法定內部財務重整權力- 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換.全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換.強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
9	若可轉換,指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇減特點	有	有
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定繼減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減,永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減・說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其		緊接三級資本票據之後
	優先的票據的票據類別)		
6	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
27	如是,指明不合規特點	不適用	不適用

_	條款與細則	條款與細則 - 資本票據4 ³	條款與細則 - 資本票據5 ³
3	37 如是·指明不合規特點	不適用	不適用
	36	没有	沒月

第(i	i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	6) 永久後償貸款(6億美元)	7) 永久後償貸款(7億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
3	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	額外一級	額外一級
a	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的) 可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)	單獨及集團 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及集團 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	永久債務票據	永久債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	4,685百萬港元	5,467百萬港元
а	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	4,685百萬港元	5,467百萬港元
	票據面值	6億美元	7億美元
0	會計分類	股東權益	股東權益
1	最初發行日期	2019年6月26日	2019年6月21日
2	永久性或設定期限	永久	永久
3	原訂到期日	不適用	不適用
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2027年5月22日按面值贖回	可於2025年3月30日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	由2027年5月22日起 · 分派率由固定的5.91厘改 為3個月倫敦銀行同業拆息+3.95厘	由2025年3月30日起·分派率由固定的6.172 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.23厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
0	全部酌情、部分酌情·或強制	全部酌情	全部酌情
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	非累計	非累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換・轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下 法定內部財務重整權力- 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換.全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
3	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換・強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
9	若可轉換・指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務] 整權力而定
0	撇減特點	有	有
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減,全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
35	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	緊接二級資本票據之後	緊接二級資本票據之後
36	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
37	如是·指明不合規特點	不適用	不適用

	條款與細則	條款與細則 - 資本票據6 ³	條款與細則 - 資本票據7 ³
37	如是.指明不合規特點	不適用	不適用
		汉 月	<u>次</u> 月

第(i	i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	8) 永久後償貸款(9億美元)	9) 永久後償貸款(11億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
;	票據的管限法律	香港法律	香港法律
а	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	額外一級	額外一級
a	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的) 可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能	單獨及集團 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及集團 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	力目的) 票據類別(由各司法管轄區指明)	永久債務票據	永久債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	7,044百萬港元	8,617百萬港元
а	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期)	7.044百萬港元	8,617百萬港元
-		9億美元	11億美元
0	會計分類	股東權益	股東權益
0 1	最初發行日期	2019年6月14日	2019年6月18日
2	永久性或設定期限	永久	永久
3	原訂到期日	不適用	不適用
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日、以及贖回價	~	~
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
0	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息/票息	固定至浮動	固定至浮動
, 8	三尺3/F到众心/示心 票息率及任何相關指數	由2024年9月17日起·分派率由固定的6.03厘改	
9	有停止派發股息的機制	為3個月倫敦銀行同業拆息+4.020厘 沒有	3個月倫敦銀行同業拆息+4.060厘 沒有
0	全部酌情、部分酌情,或強制	全部酌情	全部酌情
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2		非累計	非累計
3			
4	若可轉換,轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力- 香港金管局(《處置機制條例》)	
5	若可轉換.全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換·強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換·指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
0	撇減特點	有	有
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	······	
4	若屬臨時撇減,說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
35	■ 法 () () () () () () () () () (緊接二級資本票據之後
86	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
27	如是·指明不合規特點	不適用	不適用

	條款與細則	條款與細則 - 資本票據8 ³	條款與細則 - 資本票據9 ³
37	如是.指明不合規特點	不適用	不適用
00		及月	汉方

第(i	i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	10) 2031年到期後償貸款(6億美元)	11) 2030年到期後償貸款(10億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
3	票據的管限法律	香港法律	香港法律
3a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
ļ	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	二級	二級
	可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	單獨及集團	單獨及集團
а	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	其他二級資本票據	其他二級資本票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	5,183百萬港元	8,539百萬港元
а	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計 · 於最近的報告日期)	5,183百萬港元	8,539百萬港元
	票據面值	6億美元	10億美元
0	會計分類	負債——公允值	負債——公允值
1	最初發行日期	2019年6月14日	2019年6月18日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2031年11月23日	2030年8月18日
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2026年11月23日按面值贖回	可於2025年8月18日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	由2026年11月23日起·分派率由固定的4.22厘 改為3個月倫敦銀行同業拆息+2.17厘	由2025年8月18日起·分派率由固定的4.07 為3個月倫敦銀行同業拆息+2.07厘
19	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
0	全部酌情、部分酌情·或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換.轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下: 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換・全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換・強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
80	撇減特點	有	有
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
32	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減,永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
35	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)		緊接吸收虧損能力票據之後
36	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
37	如是,指明不合規特點	不適用	不適用

	條款與細則	條款與細則 - 資本票據10 ³	條款與細則 - 資本票據11 ³
37	如是・指明不合規特點	不適用	不適用
50		汉 泊	及归

第(ii	i)部分 監管資本及吸收虧損能力要求	12) 2030年到期後償貸款(1.8億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用
	票據的管限法律	香港法律
а	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律	不適用
	管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	
	監管處理方法	
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	
	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	單獨及集團
a	可計入單獨 / 吸收虧損能力綜合集團 / 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 (就吸收虧損能 力目的)	車狥及吸收虧預能刀綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	其他二級資本票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計‧於最近的報告日期)	1,551百萬港元
a	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	1,551百萬港元
	票據面值	1.8億美元
)	會計分類	負債——公允值
	最初發行日期	2019年5月30日
2	永久性或設定期限	設定期限
;	原訂到期日	2030年8月18日
Ļ	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日、以及贖回價	可於2025年8月18日按面值贖回
3	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息	
7	固定或浮動股息/票息	固定至浮動
}	票息率及任何相關指數	由2025年8月18日起·分派率由固定的4.3厘。
		為3個月倫敦銀行同業拆息+2.1厘
9	有停止派發股息的機制	沒有
)	全部酌情、部分酌情·或強制	強制
l	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有
2	非累計或累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換
4	若可轉換,轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換・全部或部分	可全部或部分轉換
3	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定
7	若可轉換.強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
3	若可轉換·指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
)	撇減特點	有
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 •根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減
-	若撇減、永久或臨時性質	永久
1	若屬臨時撇減,說明回復機制	不適用
- la	後償類別	合約性
5	後長來加 清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	
	可過遊价太全相特點	沒右

36	可過渡的不合規特點	沒有
37	如是.指明不合規特點	不適用
	條款與細則	條款與細則 - 資本票據12 ³

第(ii	i)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	13) 2022年到期後償貸款(5.7億美元)	14) 2024年到期後償貸款(5.75億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不適用	不適用
	可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用
a	可計入單獨 / 吸收虧損能力綜合集團 / 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 (就吸收虧損能 力目的) 西は無限 / 由名司法等 # 原本 = 1		單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計 · 於最近的報告日期)	不適用	不適用
1	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期) 票據面值	4,487百萬港元	4,718百萬港元
		5.7億美元	5.75億美元
) 1	會計分類	負債——公允值 2010年6月21日	負債——公允值 2010年6月21日
	最初發行日期	2019年6月21日	2019年6月21日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2022年9月24日	2024年9月26日
1	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日,以及贖回價	可於2021年9月24日按面值贖回	可於2023年9月26日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	栗息率及任何相關指數	由2021年9月24日起·分派率由固定的2.8厘改 為3個月倫敦銀行同業拆息+0.92厘	由2023年9月26日起·分派率由固定的3.12厘 為3個月倫敦銀行同業拆息+1.276厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
)	全部酌情、部分酌情·或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換·轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換・全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換,轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
,	若可轉換,強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換,指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定繼減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇》 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 ⁻ 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減.全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減,永久或臨時性質	永久	永久
1	若屬臨時撇減・說明回復機制	不適用	不適用
1a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)		緊接優先債權人之後
	コ洞海仏子へ相離開	沒有	沒有
6	可過渡的不合規特點	(A))	12/13
6 7	问题波的不言规行勤 如是·指明不合規特點	不適用	不適用

第(ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	15) 2027年到期後償貸款(6.3億美元)	16) 2028年到期後償貸款(7.25億美元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
		7. 法 田	7 法 田
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ² 可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用 不適用	不適用 不適用
ı	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能力 可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)		^{不過用} 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期)	不適用	不適用
1	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	5,275百萬港元	6,072百萬港元
	票據面值	6.3億美元	7.25億美元
)	會計分類	負債——公允值	負債——公允值
	最初發行日期	2019年6月21日	2019年6月21日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2027年9月25日	2028年3月2日
ŀ	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2026年9月25日按面值贖回	可於2027年3月2日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
3	票息率及任何相關指數	由2026年9月25日起·分派率由固定的3.57厘改 為3個月倫敦銀行同業拆息+1.618厘	[由2027年3月2日起·分派率由固定的3.61厘] 為3個月倫敦銀行同業拆息+1.64厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
)	全部酌情、部分酌情,或強制	強制	31.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.
	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
ŀ	若可轉換・轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下: 法定內部財務重整權力- 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換・全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
;	若可轉換,轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
,	若可轉換,強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換,指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
9	若可轉換・指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定
0	撇減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
ŀ	若屬臨時撇減・說明回復機制	不適用	不適用
1a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據類別)		緊接優先債權人之後
6	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
7	如是·指明不合規特點	不適用	不適用
	條款與細則	條款與細則 - 資本票據15 ³	<i>條款與細則 - 資本票據</i> 16 ³

第(i	ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	17) 2024年到期後償貸款(6.5億澳元)	18) 2024年到期後償貸款(3.5億澳元)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法	7 法 田	7.)注田
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ² 可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎 (就監管資本目的)	不適用	不適用 不適用
a	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能力 前計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)		个適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	不適用	不適用
a	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	3,846百萬港元	2,071百萬港元
	票據面值	6.5億澳元(4.96億美元)	3.5億澳元(2.67億美元)
0	會計分類	負債──攤銷成本	負債——攤銷成本
1	最初發行日期	2017年11月16日	2017年11月16日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2024年2月16日	2024年2月16日
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2023年2月16日按面值贖回	可於2023年2月16日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	3個月銀行票據掉期利率+1.55厘	由2023年2月16日起·分派率由固定的3.843 改為銀行票據掉期利率+1.55厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
0	全部酌情、部分酌情,或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換.轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換,全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
3	若可轉換.轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換.強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定攤減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)		緊接優先債權人之後
6	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
7	如是,指明不合規特點	不適用	不適用
	條款與細則	條款與細則 - 資本票據17 ³	<i>條款與細則- 資本票據</i> 18 ³

第(iii)部分	僅吸收虧損能力((但非監管資本)要求	

19) 2023年到期後償貸款(17.5億美元)

20) 2028年到期後償貸款(17.5億美元)

1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
3	票據的管限法律	香港法律	香港法律
Ba	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據) 監管處理方法	不適用	不適用
1		不適用	不適用
+ 5		不適用	不適用
5	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ² 可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用
5 Ga	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)		單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
7	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
3	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期)	不適用	不適用
Ba	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	14,009百萬港元	15,096百萬港元
9	票據面值	17.5億美元	17.5億美元
0	會計分類	負債──公允值	負債——公允值
11	最初發行日期	2017年3月13日	2017年3月13日
12	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2023年3月13日	2028年3月13日
14	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
15	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2022年3月13日按面值贖回	可於2027年3月13日按面值贖回
16	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
17	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
18	票息率及任何相關指數	由2022年3月13日起·分派率由固定的3.43厘改 為3個月倫敦銀行同業拆息+1.328厘	由2027年3月13日起·分派率由固定的4.1860 厘改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.739厘
19	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
20	全部酌情、部分酌情,或強制	強制	強制
21	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
22	非累計或累計	累計	累計
23	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
24	若可轉換・轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
25	若可轉換,全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
25 26			
		須待轉換時釐定 <u>サ工作</u> 供法研究力没想地被挽	須待轉換時釐定 <u>苯工作供請加後为治生性</u> 糖格
27 28	若可轉換 · 強制或可選擇性轉換 若可轉換 · 指明轉換後的票據類別	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換 須視平《處置機制條例》下之法定內部財務重
	石山静疾,担州静疾使的宗旗规则	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須祝于《處皇儀制條例》下之法定內部財務里 整權力而定
29	若可轉換.指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
30	撇減特點	是	是
31	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力
32	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
33	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
34	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用	不適用
84a	後償類別	合約性	合約性
35	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	緊接優先債權人之後	緊接優先債權人之後
36	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
37	如是.指明不合規特點	不適用	不適用
	條款與細則	條款與細則 - 資本票據19 ³	條款與細則 - 資本票據20 3

第(ⅲ)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	21) 2023年到期後償貸款(10億美元)	22) 2024年到期後償貸款(20億美元)
I	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不適用	不適用
	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用
a	可計入單獨 / 吸收虧損能力綜合集團 / 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 (就吸收虧損能 力目的)		單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別 (由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	不適用	不適用
a	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	8,140百萬港元	16,673百萬港元
	票據面值	10億美元	20億美元
)	會計分類	負債——公允值	負債——公允值
	最初發行日期	2017年11月22日	2018年5月18日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2023年11月22日	2024年5月18日
1	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2022年11月22日按面值贖回	可於2023年5月18日按面值贖回
3	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息/票息	固定至浮動	固定至浮動
3	票息率及任何相關指數	由2022年11月22日起·分派率由固定的3.305 厘改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.237厘	由2023年5月18日起·分派率由固定的4.1349 厘改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.207厘
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
C	全部酌情、部分酌情.或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
1	若可轉換・轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換.全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換,轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換.強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 •根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減,永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減.說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	緊接優先債權人之後	緊接優先債權人之後
	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
5			
6 7	如是,指明不合規特點	不適用	不適用

第(i	ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	23) 2029年到期後償貸款(30億美元)	24) 2024年到期後償貸款(793億日圓)
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
6	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則1	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不適用	不適用
	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用
а	可計入單獨/吸收虧損能力綜合集團/單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎(就吸收虧損能 力目的)		單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	不適用	不適用
а	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	26,365百萬港元	5,630百萬港元
	票據面值	30億美元	793億日圓(7.17億美元)
0	會計分類	負債──公允值	負債——公允值
1	最初發行日期	2018年6月19日	2018年9月14日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2029年6月19日	2024年9月12日
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2028年6月19日按面值贖回	可於2023年9月12日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	由2028年6月19日起·分派率由固定的4.5328 厘改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.539厘	由2023年9月12日起,分派率由固定的0.5897 厘改為3個月日圓倫敦銀行同業拆息+0.5084個
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
0	全部酌情、部分酌情·或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換·轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
5	若可轉換·全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
6	若可轉換,轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換,強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換,指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	
9	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	<i>撇</i> 減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減,永久或臨時性質	永久	永久
34	若屬臨時撇減·說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
35	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)		緊接優先債權人之後
6	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
	如是,指明不合規特點	不適用	不適用
37		-1-26/13	

第(iii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求	25) 2026年到期後償貸款(131億日圓)	26) 2028年到期後償貸款(676億日圓)
	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司
	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用
	票據的管限法律	香港法律	香港法律
a	建致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用
	監管處理方法		
	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用
	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不適用	不適用
	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用
a	力目的)	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎
	票據類別 (由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據
	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	不適用	不適用
3	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期)	928百萬港元	4,784百萬港元
	票據面值	131億日圓(1.18億美元)	676億日圓 (6.11億美元)
)	會計分類	負債──公允值	負債——公允值
1	最初發行日期	2018年9月14日	2018年9月14日
2	永久性或設定期限	設定期限	設定期限
3	原訂到期日	2026年9月12日	2028年9月12日
4	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是
5	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	可於2025年9月12日按面值贖回	可於2027年9月12日按面值贖回
6	後續贖回日(如適用)	首個贖回日之後的每個付息日	首個贖回日之後的每個付息日
	票息 / 股息		
7	固定或浮動股息 / 票息	固定至浮動	固定至浮動
8	票息率及任何相關指數	由2025年9月12日起 · 分派率由固定的0.6854 厘改為3個月日圓倫敦銀行同業拆息+0.5391厘	由2027年9月12日起·分派率由固定的0.798 厘改為3個月日圓倫敦銀行同業拆息+0.5839/
9	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
)	全部酌情、部分酌情,或強制	強制	強制
1	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
2	非累計或累計	累計	累計
3	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
4	若可轉換,轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	
5	若可轉換.全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
3	若可轉換、轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
7	若可轉換,強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
8	若可轉換・指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	
9	若可轉換・指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
0	撇減特點	是	是
1	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定纖 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》 香港金管局法定內部財務重整權力
2	若撇減·全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
3	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
4	若屬臨時撇減・說明回復機制	不適用	不適用
4a	後償類別	合約性	合約性
5	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據頻別)		緊接優先債權人之後
6	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
6 7	可過渡的不合規特點 如是·指明不合規特點	沒有 不適用	沒有 不適用

第(iii) 部分	僅吸收虧損能力((但非監管資本)) 要求
		[二7] 二日只个	

27) 2036年到期後償貸款(20億美元)

28)	2026年到期後償貸款	(25億美元)

(矛(III)却力 谨呶收散俱能力(世非监官具本)女状						
1	發行人	香港上海滙豐銀行有限公司	香港上海滙豐銀行有限公司					
2	獨有識別碼(如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)	不適用	不適用					
3	票據的管限法律	香港法律	香港法律					
3a	達致《總吸收虧損能力細則清單》第13條的可強制執行規定的方法(適用於受非香港法律 管限的非資本吸收虧損能力債務票據)	不適用	不適用					
	監管處理方法							
4	《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹	不適用	不適用					
5	《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ²	不適用	不適用					
6	可計入單獨/集團/單獨及集團基礎(就監管資本目的)	不適用	不適用					
6a	力目的)	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎	單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎					
7	票據類別(由各司法管轄區指明)	非資本吸收虧損能力債務票據	非資本吸收虧損能力債務票據					
8	在監管資本的確認數額(以有關貨幣百萬計・於最近的報告日期)	不適用	不適用					
8a	在吸收虧損能力的確認數額(以有關貨幣百萬計·於最近的報告日期)	16,530百萬港元	20,628百萬港元					
9	票據面值	20億美元	25億美元					
10	會計分類	負債──攤銷成本	負債——攤銷成本					
11	最初發行日期	2017年11月9日	2017年11月27日					
12	永久性或設定期限	設定期限	設定期限					
13	原訂到期日	2036年9月8日	2026年5月25日					
14	須獲監管當局事先批准的發行人贖回權	是	是					
15	可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價	不適用	不適用					
16	後續贖回曰(如適用)	不適用	不適用					
	票息 / 股息							
17	固定或浮動股息 / 票息	固定	固定					
18	票息率及任何相關指數	4.2125厘	4.0530厘					
19	有停止派發股息的機制	沒有	沒有					

19	有停止派發股息的機制	沒有	沒有
20	全部酌情、部分酌情,或強制	強制	強制
21	設有遞升息率或其他贖回誘因	沒有	沒有
22	非累計或累計	累計	累計
23	可轉換或不可轉換	可轉換	可轉換
24	若可轉換,轉換觸發事件	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)	觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定內部財務重整權力 – 香港金管局(《處置機制條例》)
25	若可轉換·全部或部分	可全部或部分轉換	可全部或部分轉換
26	若可轉換·轉換比率	須待轉換時釐定	須待轉換時釐定
27	若可轉換·強制或可選擇性轉換	若干條件達致後為強制性轉換	若干條件達致後為強制性轉換
28	若可轉換,指明轉換後的票據類別	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
29	若可轉換·指明轉換後的票據發行人	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定	須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定
30	撇減特點	是	是
31	若撇減・撇減觸發事件	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力	借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 。根據合約條款規定確認《處置機制條例》下 香港金管局法定內部財務重整權力
32	若撇減・全部或部分	可部分撇減	可部分撇減
33	若撇減・永久或臨時性質	永久	永久
34	若屬臨時撇減・説明回復機制	不適用	不適用
34a	後償類別	合約性	合約性
35	清盤時在償還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其 優先的票據的票據類別)	緊接優先債權人之後	緊接優先債權人之後
36	可過渡的不合規特點	沒有	沒有
37	如是.指明不合規特點	不適用	不適用
	條款與細則	<i>條款與細則 - 資本票據</i> 27 ³	<i>條款與細則 - 資本票據</i> 28 ³

註釋:

- 1
- 資本票據的監管處理方法須依照《銀行業(資本)規則》附表4H所載的過渡安排 資本票據的監管處理方法無須依照《銀行業(資本)規則》附表4H所載的過渡安排 條款與細則應與總條款協議(「總條款協議」)一併閱讀 2
- 3

總條款協議

The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited 香港上海滙豐銀行有限公司 香港皇后大道中1號滙豐總行大廈 電話: (852) 2822 1111 傳真: (852) 2810 1112 www.hsbc.com.hk