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

於2020年6月30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(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(ii)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(iii)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 |
| 29 2022年到期後償貸款(25億美元) | 20 |
| | |
| 註釋 | 21 |

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。

| 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) |
|----------|---|--|
| 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) | GB0004355490 |
| 3 | 票據的管限法律 | 英格蘭法律 |
| 3а | 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 |
| 1 | 《巴塞爾協定3》過渡期規則1 | |
| 5 | | 不可計入 |
| 3 | 《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 |
| Sa | 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) | 不適用 |
| 7 | 票據類別(由各司法管轄區指明) | 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) | 3,100百萬港元 |
| Ва | 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 |
| 10 | 會計分類 | 負債——攤銷成本 |
| 11 | 最初發行日期 | 1986年7月9日 |
| 2 | 永久性或設定期限 | 永久 |
| 13 | 原訂到期日 | - |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 | 是 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |
| 19 | 有停止派發股息的機制 | 沒有 |
| 20 | 全部酌情、部分酌情・或強制 | 部分酌情 |
| 21 | 設有遞升息率或其他贖回誘因 | 沒有 |
| 22 | 非累計或累計 | 累計 |
| 23 | 可轉換或不可轉換 | 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》) |
| 25 | 若可轉換・全部或部分 | 可全部或部分轉換 |
| :6 | 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 |
| 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 |
| 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 |
| 30 | 撇減特點 | |
| 31 | 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 |
| 32 | 若撇減・全部或部分 | 可部分撇減 |
| 33 | 若撇減・永久或臨時性質 | 永久 |
| 34 | 若屬臨時撇減・説明回復機制 | 不適用 |
| 34a | 後償類別 | 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) | 緊接較優先二級資本票據之後 |
| | 可過渡的不合規特點 | |
| 56 | | |
| 36 37 | 如是・指明不合規特點 | 未設無法持續營運時彌補虧損條款。 |

| 第(i | i)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 |
| , | 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) 監管處理方法 | 不適用 | 不適用 |
| | 《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 | 普通股權一級 | 額外一級 |
| 3 | 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 |
| ia | 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) | 普通股 | 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) | 170,880百萬港元 | 7,834百萬港元 |
| 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) | 170,880百萬港元 | 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 |
| 0 | 會計分類 | 股東權益 | 股東權益 |
| 1 | 最初發行日期 | 多個 | 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 | 不適用 | 是 |
| 5 | 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 |
| 6 | 後續贖回日(如適用) | 不適用 | 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 | 不適用 | 固定至浮動 |
| 8 | 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 |
| 9 | 有停止派發股息的機制 | 不適用 | 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.08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 | 不適用 | 沒有 |
| 2 | 成 另 题 月 题 月 题 月 题 图 图 图 图 图 图 图 图 图 图 图 图 图 | 非累計 | 非累計 |
| 3 | 可轉換或不可轉換 | 不可轉換 | 可轉換 |
| 4 | 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 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 | 不適用 | 可全部或部分轉換 |
| 6 | 若可轉換,轉換比率 | 不適用 | 須待轉換時釐定 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 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 整權力而定 |
| 0 | 撇減特點 | 不適用 | |
| 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 。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 | 不適用 | 可部分撇減 |
| 3 | 若撇減・永久或臨時性質 | 不適用 | 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 | 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) | 緊接額外一級之後 | 緊接二級資本票據之後 |
| 6 | 可過渡的不合規特點 | | |
| | | | |
| 37 | 如是・指明不合規特點 | 不適用 | 不適用 |

| 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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| За | 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 |
| 1 | 監管處理方法 《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 | 額外一級 | 額外一級 |
| 3 | 《C 差 网 励 た 3 》 過 波 刑 後 放 則 可計 入 單 濁 ノ 集 團 ノ 單 濁 及 集 團 基 礎 (就 監 管 資 本 目 的) | 單獨及集團 | 單獨及集團 |
| a Ba | 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 | 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 | 能力目的) 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 |
| 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) | 7,064百萬港元 | 3,905百萬港元 |
| 3a | 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) | 7,064百萬港元 | 3,905百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 9億美元 | 5億美元 |
| 10 | 會計分類 | 股東權益 | 股東權益 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年5月30日 | 2019年6月21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 | 是 | 是 |
| 15 | 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 |
| 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 | 由2025年3月30日起·分派率由固定的6.172月 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.23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 | 全部酌情 | 全部酌情 |
| 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 | 非累計 | 非累計 |
| 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 | | 有 |
| 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 | 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 |
| 32 | 若撇減・全部或部分 | 可部分撇減 | 可部分撇減 |
| 33 | 若臘減,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 |
| 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 | | |
| 36 37 | 可過渡的不合規特點 如是·指明不合規特點 | 沒有 | 沒有不適用 |

| 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 |
| За | 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 |
| 1 | 監管處理方法 《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 | 額外一級 | 額外一級 |
| 5 6 | 《 | 單獨及集團 | 單獨及集團 |
| 3 Ga | 可計入單獨/聚崗/平均次聚崗至唯(城區百貫平百時) 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) | 永久債務票據 | 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) | 4,686百萬港元 | 5,467百萬港元 |
| За | 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) | 4,686百萬港元 | 5,467百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 6億美元 | 7億美元 |
| 10 | 會計分類 | 股東權益 | 股東權益 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年6月26日 | 2019年6月21日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 永久 | 永久 |
| 13 | 原訂到期日 | | 不適用 |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 | 是 | 是 |
| 15 | 可撰擇贖回日、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 |
| 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 |
| 18 | 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厘 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.23厘 |
| 19 | 有停止派發股息的機制 | | 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 | 沒有 | 沒有 |
| 22 | 非累計或累計 | 非累計 | 非累計 |
| 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 |
| 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 | 撤減特點 | 有 | 有 |
| 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撤減 。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 | 若繼減,永久或臨時性質 | | 永久 |
| 34 | 若屬臨時撇減.說明回復機制 | 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價權人等級中緊接較 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 |
| 36 37 | 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(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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| 3а | 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 |
| 4 | 監管處理方法 《巴塞爾協定3》過渡期規則 ¹ | | 不適用 |
| 5 | 《巴塞爾協定3》過渡期後規則 ² | 額外一級 | 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 |
| 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) | 永久債務票據 | 永久債務票據 |
| 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) | 7,044百萬港元 | 8,617百萬港元 |
| 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) | 7,044百萬港元 | 8,617百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 9億美元 | 11億美元 |
| 10 | 會計分類 | 股東權益 | 股東權益 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年6月14日 | 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 | 是 | 是 |
| 15 | 可選擇贖回日、或有贖回日・以及贖回價 | 可於2024年9月17日按面值贖回 | 可於2024年6月18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2024年9月17日起·分派率由固定的6.03厘 改為3個月倫敦銀行同業拆息+4.020厘 | 由2024年6月18日起·分派率由固定的6厘改為 3個月倫敦銀行同業拆息+4.060厘 |
| 19 | 有停止派發股息的機制 | | 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 | 沒有 | 沒有 |
| 22 | 非累計或累計 | 非累計 | 非累計 |
| 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 |
| 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 | 有 | 有 |
| 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 |
| 34 | 若屬臨時臘減·說明回復機制 | 不適用 | 不適用 |
| 34a | 後償類別 | 合約性 | 合約性 |
| Ja | | 緊接二級資本票據之後 | 緊接二級資本票據之後 |
| | 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) | 系.J文—成貝 平示J除之 l交 | |
| 35 | | 沒有 | 沒有 |
| 35 36 37 | 其優先的票據的票據類別) | | 沒有不適用 |

| 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) 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 | | 二級 |
| 3 | 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 |
| За | 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) | 其他二級資本票據 | 其他二級資本票據 |
| 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) | 5,152百萬港元 | 8,435百萬港元 |
| 3a | 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) | 5,152百萬港元 | 8,435百萬港元 |
|) | 票據面值 | 6億美元 | 10億美元 |
| 10 | 會計分類 | 負債——公允值 | 負債——公允值 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年6月14日 | 2019年6月18日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2031年11月23日 | 2030年8月18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2026年11月23日按面值贖回 | 可於2025年8月18日按面值贖回 |
| 16 | 後續贖回日(如適用) 票息/股息 | 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 |
| 17 | 固定或浮動股息 / 票息 | | 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 | |
| 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 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 |
| 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 |
| 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 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 整權力而定 |
| 30 | 撇減特點 | | 有 |
| 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 | 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 |
| 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 |
| 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) | 緊接吸收虧損能力票據之後 | 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103 | 條款與細則 - 資本票據113 |
| | | | |

| 第(i | 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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 |
| 3а | 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 | |
| 4 | 《巴塞爾協定3》過渡期規則1 | 不適用 |
| 5 | 《巴塞爾協定3》過渡期後規則2 | 二級 |
| 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 |
| 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 |
| 7 | 票據類別(由各司法管轄區指明) | 其他二級資本票據 |
| 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) | 1,534百萬港元 |
| 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) | 1,534百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 1.8億美元 |
| 10 | 會計分類 | 負債公允值 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年5月30日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2030年8月18日 |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 | 是 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 | |
| 17 | 固定或浮動股息 / 票息 | 固定至浮動 |
| 18 | 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厘克 為3個月倫敦銀行同業拆息+2.1厘 |
| 19 | 有停止派發股息的機制 | 沒有 |
| 20 | 全部酌情、部分酌情,或強制 | 強制 |
| 21 | 設有遞升息率或其他贖回誘因 | 沒有 |
| 22 | 非累計或累計 | 累計 |
| 23 | 可轉換或不可轉換 | 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》) |
| 25 | 若可轉換・全部或部分 | 可全部或部分轉換 |
| 26 | 若可轉換・轉換比率 | 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 |
| 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 |
| 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 |
| 30 | 撇減特點 | 有 |
| 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 |
| 32 | 若撇減・全部或部分 | 可部分撇減 |
| 33 | 若撇減・永久或臨時性質 | 永久 |
| 34 | 若屬臨時撤減,說明回復機制 | 不適用 |
| 34a | 後價類別 | 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 |
| 07 | 如是,指明不合規特點 | 不適用 |
| 37 | | |

| 第(i | iii)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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| За | 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 |
| ļ | 《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 |
| 3 | 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 |
| Sa | 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) | 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 |
| 3a | 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) | 4,546百萬港元 | 4,725百萬港元 |
|) | 票據面值 | 5.7億美元 | 5.75億美元 |
| 10 | 會計分類 | 負債——公允值 | 負債——公允值 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年6月21日 | 2019年6月21日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2022年9月24日 | 2024年9月26日 |
| 4 | 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2021年9月24日按面值贖回 | 可於2023年9月26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 | | |
| 7 | 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 改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.276厘 |
| 19 | 有停止派發股息的機制 全部酌情、部分酌情·或強制 | 沒有強制 | 沒有強制 |
| 21 | 我有遞升息率或其他贖回誘因 2. | 沒有 | 沒有 |
| 22 | 成 月 越 月 志 年 弘 兵 他 順 山 訪 凶 非 累 計 或 累 計 | 累計 | 累計 |
| | | | |
| 23 24 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 | 可轉換 | 可轉換 |
| 24 | 石山鴨揆・鴨揆胸改争什 | 觸發香港《金融機構(處置機制)條例》下之 法定内部財務重整權力 — 香港金管局(《處置機制條例》) | 爾敦音を《並融版傳(處直機制) 除例》 トン法定内部財務重整權力 — 香港金管局(《處置機制條例》) |
| 25 | 若可轉換,全部或部分 | | |
| 26 | | 可全部或部分轉換 | 可全部或部分轉換 |
| | 若可轉換・轉換比率 | 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 | 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 |
| 27 | 若可轉換·轉換比率 若可轉換·強制或可選擇性轉換 | | |
| | | 須待轉換時釐定 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 |
| 28 | 若可轉換·強制或可選擇性轉換 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務』 整權力而定 |
| 28 29 | 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 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 |
| 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 若可轉換·指明轉換後的票據發行人 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 |
| 28 29 80 31 | 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可轉換·指明轉換後的票據發行人 撒減特點 若撇減·撇減觸發事件 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換須視乎《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是 信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可部分撇減 |
| 29 30 31 32 | 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可轉換·指明轉換後的票據發行人 撤減特點 若撇減·撇減觸發事件 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換須視乎《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是 信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可部分撇減永久 |
| 28 29 80 31 32 33 | 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可轉換·指明轉換後的票據發行人 撒減特點 若撇減·撇減觸發事件 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是權力而定 是 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》 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 不適用 |
| 28 29 30 31 33 33 34 | 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可轉換·指明轉換後的票據發行人 撤減特點 若撇減·撇減觸發事件 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換須視乎《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是 信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可部分撇減永久 |
| 228 229 330 331 332 333 334 334a 335 | 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 若可轉換、指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減、撇減觸發事件 若撇減、全部或部分 若撇減、永久或臨時性質 若屬臨時撇減、說明回復機制 後償類別 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) | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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可部分撇減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |
| 28 29 33 31 33 34 34 35 | 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可轉換,指明轉換後的票據發行人 繼減特點 若撇減,繼減觸發事件 若撇減,全部或部分 若撇減,永久或臨時性質 若屬臨時撇減,說明回復機制 後價類別 清盤時在價遷優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價價時在價權人等級中緊接較 其優先的票據的票據類別) 可過渡的不合規特點 | 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是權力而定 是 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》可香港金管局法定內部財務重整權力可部分撇減永久不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |
| 27 28 29 30 31 33 34 34 33 35 36 37 | 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 若可轉換、指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減、撇減觸發事件 若撇減、全部或部分 若撇減、永久或臨時性質 若屬臨時撇減、說明回復機制 後償類別 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) | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 須待轉換時釐定若干條件達致後為強制性轉換 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 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撤別。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 可部分撤減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |

| 第(i | 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 |
| 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 |
| 3а | 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 6a | 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 (就吸收虧損 | 不適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 | 不適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 |
| 7 | 能力目的) 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 |
| 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) | 5,283百萬港元 | 6,092百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 6.3億美元 | 7.25億美元 |
| 10 | 會計分類 | 負債——公允值 | 負債——公允值 |
| 11 | 最初發行日期 | 2019年6月21日 | 2019年6月21日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2027年9月25日 | 2028年3月2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2026年9月25日按面值贖回 | 可於2027年3月2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厘战 為3個月倫敦銀行同業拆息+1.64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 |
| 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 | 撤減特點 | 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撤減 。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 |
| 34a | 後價類別 | 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 |
| | | 不適用 | 不適用 |
| 37 | 如是·指明不合規特點 條款與細則 | - 「河内 - 修款與細則 - 資本栗據15 ³ | 條款與細則 - 資本票據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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| За | 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 |
| 4 | | 7 汝 田 | 了 按田 |
| 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 |
| a 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) | 不適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 | 不適用 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 |
| 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) | 3,452百萬港元 | 1,859百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 6.5億澳元 (4.47億美元) | 3.5億澳元(2.41億美元) |
| 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16日 | 2017年11月16日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2024年2月16日 | 2024年2月16日 |
| | | 是 | |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 可選擇贖回日、或有贖回日,以及贖回價 | | 是 |
| 15 | | 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 |
| 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 | 浮動 | 固定至浮動 |
| 18 | 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 及為銀行票據掉期利率+1.55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 |
| 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 | |
| 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 |
| | 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 | 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撇減 |
| 31 | 在瓶颅,瓶颅 奶圾事计 | 。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 | 。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 |
| | 右 版 成 ・ 順 成 例 収 争 日 | | |
| 32 | | 香港金管局法定內部財務重整權力 | 香港金管局法定內部財務重整權力 |
| 32 33 | 若撇減・全部或部分 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分繼減 | 香港金管局法定內部財務重整權力可部分纖減 |
| 32 33 34 | 若繼減·全部或部分 若繼減·永久或臨時性質 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撤減 永久 |
| 32 33 34 34a 35 | 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 若屬臨時撇減·說明回復機制 後償類別 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) | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撤減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |
| 32 33 34 34a 35 | 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 若屬臨時撇減·說明回復機制 後價類別 清盤時在價遷優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價債時在價權人等級中緊接較 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 沒有 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 不適用 合約性 |
| 31 32 33 34 34a 35 36 | 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 若屬臨時撇減·說明回復機制 後償類別 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) | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撇減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分撤減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |

| 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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| 3а | 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 |
| 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 | 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) | 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) | 14,225百萬港元 | 15,197百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 17.5億美元 | 17.5億美元 |
| 10 | 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 |
| 13 | 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 |
| 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 |
| 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撤減 。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 |
| 34a | 後償類別 | 合約性 | 合約性 |
| | 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 | 緊接優先債權人之後 | 緊接優先債權人之後 |
| 35 | 其優先的票據的票據類別) | | |
| | 可過渡的不合規特點 | 沒有 | 沒有 |
| 35 36 37 | , | 沒有 不適用 | 沒有 不適用 |

| | ii)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) |
|--|--|--|--|
| 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 |
| Ва | 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 |
| 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 | 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 |
| Sa | 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) | 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) | 8,149百萬港元 | 16,811百萬港元 |
|) | 票據面值 | 10億美元 | 20億美元 |
| 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 |
| 13 | 原訂到期日 | 2023年11月22日 | 2024年5月18日 |
| 4 | 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11月22日按面值贖回 | 可於2023年5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 |
| 8 | 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4.134 厘改為3個月倫敦銀行同業拆息+1.207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 |
| | 非累計或累計 可轉換或不可轉換 | 累計 可轉換 | 累計 可轉換 |
| 23 | | | 可轉換 |
| !3 !4 | 可轉換或不可轉換 | 可轉換 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 — | 可轉換 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 — |
| 23 24 25 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 | 可轉換 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》) | 可轉換 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》) |
| 23 24 25 26 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 |
| 23 24 25 26 27 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 |
| 223 224 225 226 227 228 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 若可轉換·強制或可選擇性轉換 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定 |
| 23 24 25 26 27 28 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 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 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 整權力而定 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 |
| 23 24 25 26 27 28 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 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 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 |
| 23 24 25 26 27 28 29 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 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 若可轉換·指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減·撇減觸發事件 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 | 可轉換 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一 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 提中不定 類視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 是 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 可部分臘減 |
| 23 24 25 26 27 28 29 31 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·輸換比率 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 若可轉換·指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減·撇減觸發事件 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 | 可轉換 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一 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 是 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 可部分撇減 永久 |
| 23 24 25 26 27 28 29 30 31 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 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 若可轉換·指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減·撇減觸發事件 若撇減·撇減觸發事件 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定 境視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重 整權力而定 是 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 可部分繼減 永久 不適用 | 可轉換 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一 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務 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 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撤 。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 可部分攤減 永久 不適用 |
| 23 24 225 226 227 228 29 33 31 | 可轉換或不可轉換 若可轉換·轉換觸發事件 若可轉換·全部或部分 若可轉換·轉換比率 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 若可轉換·指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減·撇減觸發事件 若撇減·檢減觸發事件 若撇減·全部或部分 若撇減·永久或臨時性質 若屬臨時撇減·說明回復機制 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 | 可轉換 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一 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 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 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撤済。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 可部分撤減 永久 不適用 合約性 |
| 23 24 224 225 226 227 228 229 33 34 34 34 34 35 | 可轉換或不可轉換 若可轉換・轉換觸發事件 若可轉換・全部或部分 若可轉換・轉換比率 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 若可轉換・指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減・撤減觸發事件 若撇減・全部或部分 若撇減・永久或臨時性質 若屬臨時撇減・說明回復機制 後價類別 清盤時在價遷優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價價時在價權人等級中緊接較 其優先的票據的票據類別) | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 變權力而定 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 可轉換 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一 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撤 。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 可部分撇減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |
| 224 224 225 226 227 228 229 229 331 34 34 343 34 36 | 可轉換或不可轉換 若可轉換・轉換觸發事件 若可轉換・全部或部分 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 若可轉換・指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減・維減觸發事件 若撇減・全部或部分 若撇減・永久或臨時性質 若屬臨時撇減・說明回復機制 後價類別 清盤時在價遷優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價價時在價權人等級中緊接較 其優先的票據的票據類別) 可過渡的不合規特點 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 整權力而定 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 沒有 | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 提權力而定 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定撤減。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 可部分撤減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 沒有 |
| 22 23 24 25 26 27 28 29 30 31 33 34 35 36 37 | 可轉換或不可轉換 若可轉換・轉換觸發事件 若可轉換・全部或部分 若可轉換・轉換比率 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 若可轉換・指明轉換後的票據發行人 撇減特點 若撇減・撤減觸發事件 若撇減・全部或部分 若撇減・永久或臨時性質 若屬臨時撇減・說明回復機制 後價類別 清盤時在價遷優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價價時在價權人等級中緊接較 其優先的票據的票據類別) | 可轉換 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》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部財務重整權力而定 變權力而定 是 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 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 | 可轉換 觸發香港《金融機構(處置機制)條例》 法定內部財務重整權力— 香港金管局(《處置機制條例》) 可全部或部分轉換 須待轉換時釐定 若干條件達致後為強制性轉換 須視乎《處置機制條例》下之法定內部與 整權力而定 是 借款人無法持續營運時根據合約條款規定 。根據合約條款規定確認《處置機制條係 香港金管局法定內部財務重整權力 可部分繼減 永久 不適用 合約性 緊接優先債權人之後 |

| 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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 香港法律 | 香港法律 |
| 3а | 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 | 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) | 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 9 | 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 | 26,870百萬港元 30億美元 | 5,727百萬港元 793億日圓(7.36億美元) |
| 10 | 會計分類 | 負債——公允值 | 負債──公允值 |
| | | | 2018年9月14日 |
| 11 12 | 最初發行日期 永久性或設定期限 | 2018年6月19日 設定期限 | 2018年9月14日 設定期限 |
| 12 13 | | 設定期限 2029年6月19日 | 設定期限 2024年9月12日 |
| | 原訂到期日 海海路等学民事生批准的發行人應回標 | | 是 |
| 14 15 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 可選擇贖回日、或有贖回日,以及贖回價 | 是 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 |
| - | | | |
| 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 |
| 17 | 票息/股息 | 田中不安勢 | 田中不必執 |
| 17 18 | 固定或浮動股息/票息 | _ 固定至浮動 由2028年6月19日起・分派率由固定的4.5328 | 固定至浮動 |
| 10 | 票息率及任何相關指數 | 国2028年6月19日起· 万派卒田回走时4.5328 里改為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 |
| 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撤減 。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 | 若臘減,永久或臨時性質 | 永久 | 永久 |
| 34 | 若屬臨時臘減・説明回復機制 | 不適用 | 不適用 |
| 34a | 後償類別 | 合約性 | 合約性 |
| 0.5 | 清盤時在價還優次級別中的位置(指明相關法律實體無力價債時在價權人等級中緊接較 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 |
| 35 | >< S > 0 0 1 1 1 1 1 1 1 1 | | |
| | 可過渡的不合規特點 | 沒有 | 沒有 |
| 35 36 37 | , | | 沒有 不適用 |

| 第(i | 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) |
|----------------|---|---|---|
| 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) 監管處理方法 | 不適用 | 不適用 |
| | 《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 |
| 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) | 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) | 928百萬港元 | 4,718百萬港元 |
| | 票據面值 | 131億日圓(1.22億美元) | 676億日圓(6.28億美元) |
| 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 |
| _ | 票息 / 股息 | | |
| 7 | 固定或浮動股息 / 票息 | | 固定至浮動 |
| 8 | 票息率及任何相關指數 | | · · · · · · · · · · · · · · · · · · |
| | | 厘改為3個月日圓倫敦銀行同業拆息+0.5391厘 | 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 |
| 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 |
| :3 | 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 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 |
| 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 |
| 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 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 整權力而定 |
| 80 | 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撤。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 |
| 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 |
| _ | 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 | 緊接優先債權人之後 | 緊接優先債權人之後 |
| | 其優先的票據的票據類別) | | |
| 36 | 可過渡的不合規特點 | | 沒有 |
| 35 36 37 | , , , , , , , , , , , , , , , , , , , | 沒有 不適用 條款與細則 - 資本票據 25 ³ | 沒有 不適用 <i>條款與細則 - 資本票據</i> 26 ³ |

| 第(i | ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求 | 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) |
|----------|--|---|---|
| 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 |
| 3а | 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 6a | 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) | 不適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 | 不適用 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) | 19,561百萬港元 | 21,529百萬港元 |
| 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 | 後續贖回日(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 20 | 有停止派發股息的機制 全部酌情、部分酌情、或強制 | 沒有 強制 | 沒有 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權減 。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 | 若屬臨時臘減・說明回復機制 | 不適用 | 不適用 |
| 34a | 後價類別 | 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 條款與細則 | 不適用 | 不適用 |
| | | <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 |

| 第(i | ii)部分 僅吸收虧損能力(但非監管資本)要求 | 29) 2022年到期後償貸款(25億美元) |
|----------|---|---|
| 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 |
| 3 | 票據的管限法律 | 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) 監管處理方法 | 不適用 |
| 4 | | 了 海田 |
| 5 | 《巴塞爾協定3》過渡期規則1 | 不適用 |
| 6 | 《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) | |
| 6 6а | 可引入單獨/展團/單獨及集團基礎(航監官員本日的)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 | 不適用 單獨及吸收虧損能力綜合集團基礎 |
| | 能力目的) | |
| 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 |
| 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 |
| 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) | 19,960百萬港元 |
| 9 | 票據面值 | 25億美元 |
| 10 | 會計分類 | 負債—攤銷成本 |
| 11 | 最初發行日期 | 2018年1月5日 |
| 12 | 永久性或設定期限 | 設定期限 |
| 13 | 原訂到期日 | 2022年1月5日 |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權 | 是 |
| 15 | 可選擇贖回日、或有贖回日,以及贖回價 | 不適用 |
| 16 | 後續贖回日(如適用) | 不適用 |
| | 票息 / 股息 | |
| 17 18 | 固定或浮動股息 / 票息 票息率及任何相關指數 | 3.2600厘 |
| | | |
| 19 | 有停止派發股息的機制 | 沒有 |
| 20 | 全部酌情、部分酌情・或強制 | 強制 |
| 21 | 設有遞升息率或其他贖回誘因 | 沒有 |
| 22 | 非累計或累計 | 累計 |
| 23 | 可轉換或不可轉換 | 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》) |
| 25 | 若可轉換・全部或部分 | 可全部或部分轉換 |
| 26 | 若可轉換・轉換比率 | 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 |
| 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 |
| 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 |
| 30 | 撇減特點 | 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 |
| 32 | 若撇減・全部或部分 | 可部分撇減 |
| 33 | 若撇減、永久或臨時性質 | 永久 |
| 34 | 若屬臨時撇減,說明回復機制 | 不適用 |
| 34a | 後償類別 | 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價權人等級中緊接較 其優先的票據的票據類別) | 緊接優先債權人之後 |
| 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29 ³ |

註釋:

- 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」)—併閱讀 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