

摩根士丹利亞洲國際有限公司

季度財務披露報告

二零一七年三月三十一日

摩根士丹利亞洲國際有限公司

未經審計季度財務披露報告  
二零一七年三月三十一日

目錄	頁次
標準披露模版	1
主要資本比率披露	2

# 摩根士丹利亞洲國際有限公司

## 未經審計季度財務披露報告

二零一七年三月三十一日

### 1. 標準披露模版

#### 風險加權數額概覽

下表顯示香港金融管理局指定的標準披露模版，有關摩根士丹利亞洲國際有限公司（「本公司」）之風險加權數額的詳細細目分類，概述各類風險的資本規定。

		風險加權數額		最低資本規定
		於二零一七年 三月三十一日 千美元	於二零一六年 十二月三十一日 千美元	於二零一七年 三月三十一日 千美元
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	426,418	418,390	34,113
2	其中標準(信用風險)計算法(「STC 計算法」)	426,418	418,390	34,113
2a	其中基本計算法(「BSC 計算法」)	-	-	-
3	其中內部評級基準計算法(「IRB 計算法」)	-	-	-
4	對手方信用風險	5,707	7,995	457
5	其中信用方信用風險承擔標準法(「SA-CCR 計算法」)	-	-	-
5a	其中現行風險承擔方法	3,923	5,496	314
6	其中內部模式(對手方信用風險)計算法(「IMM(CCR) 計算法」)	-	-	-
7	使用市場基準計算法的銀行帳內股權風險承擔	-	-	-
8	集體投資計劃風險承擔 – LTA	-	-	-
9	集體投資計劃風險承擔 – MBA	-	-	-
10	集體投資計劃風險承擔 – FBA	-	-	-
11	交收風險	-	-	-
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔	-	-	-
13	其中內部評級基準(證券化)計算法(「IRB(S)計算法」) – 評級基準方法	-	-	-
14	其中 IRB(S)計算法 – 監管公式方法	-	-	-
15	其中標準(證券化)計算法(「STC(S)計算法」)	-	-	-
16	市場風險	-	-	-
17	其中標準(市場風險)計算法(「STM 計算法」)	-	-	-
18	其中內部模式計算法(「IMM 計算法」)	-	-	-
19	業務操作風險	416,170	420,519	33,294
20	其中基本指標計算法(「BIA 計算法」)	416,170	420,519	33,294
21	其中標準(業務操作風險)計算法(「STO 計算法」)	-	-	-
21a	其中替代標準計算法(「ASA 計算法」)	-	-	-
22	其中高級計算法(「AMA 計算法」)	N/A	N/A	N/A
23	低於扣減門檻的數額(須計算 250%風險權重)	-	-	-
24	資本下限調整	-	-	-
24a	風險加權數額扣減	923	990	74
24b	其中不包括在二級資本內的一般銀行業務風險監管儲備及集體準備金的部分	923	990	74
24c	其中不包括在二級資本內的土地及建築物因價值重估而產生的累積公平價值收益的部分	-	-	-
25	總計	847,372	845,914	67,790

N/A：不適用於香港情況

未經審計季度財務披露報告

二零一七年三月三十一日

1. 標準披露模版 (續)

風險加權數額概覽 (續)

於二零一七年三月三十一日及二零一六年十二月三十一日之資本充足比率根據《銀行業條例》的《銀行業(資本)規則》計算。本公司採用以下計算法計算其資本要求：

- (a) 信用風險: STC計算法; 及
- (b) 業務操作風險: BIA 計算法。

於二零一七年三月三十一日及二零一六年十二月三十一日，因本公司獲香港金融管理局豁免計算市場風險，本公司未有市場風險的風險加權數額。

此披露按照相關計算方法計算得出的本公司風險加權數額乘以8%得出，並非本公司的實際「監管資本」。

於本季度報告期內，信用風險及業務操作風險的風險加權數額未有重大改變。

2. 主要資本比率披露

(a) 普通股權一級(「CET1」)資本比率

	於二零一七年 三月三十一日 千美元
CET1 資本	202,122
總風險加權數額	847,372
CET1 資本比率	24%

(b) 一級資本比率

	於二零一七年 三月三十一日 千美元
一級資本	202,122
總風險加權數額	847,372
一級資本比率	24%

(c) 總資本比率

	於二零一七年 三月三十一日 千美元
總資本	207,501
總風險加權數額	847,372
總資本比率	24%

摩根士丹利亞洲國際有限公司

未經審計季度財務披露報告

二零一七年三月三十一日

2. 主要資本比率披露（續）

(d) 槓桿比率

	於二零一七年 三月三十一日 千美元
一級資本	202,122
風險承擔總額	4,453,266
槓桿比率	4.54%