摩根士丹利銀行亞洲有限公司

未經審計季度財務披露報告

二零二六年九月三十日

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二六年九月三十日

目錄 頁次

A. 編製基準 1

B. 主要審慎比率 2

C. 風險加權數額概覽 3

D. 槓桿比率 4

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二六年九月三十日

A. 編製基準

公司資料

摩根士丹利銀行亞洲有限公司（「MSBAL」，或「本公司」）為一間於香港註冊成立的私人有限公司，擁有設於香港的總辦事處及設於新加坡的分行。本公司設有一間附屬公司，摩根士丹利銀行國際（中國）有限公司，於中國註冊成立。MSBAL 連同其附屬公司組成 MSBAL 集團（「MSBAL 集團」）。

編製基準

除另有説明外，未經審計季度財務披露報告將根據《銀行業（披露）規則》按合併基準編製（即包括 MSBAL 集團附屬公司的業務）。

MSBAL集團之資本充足率根據《銀行業（資本）規則》計算。以下計算法受採用以計算其資本要求：

(a) 信用風險：標準（信用風險）計算法 (「STC 計算法」)；
(b) 對手方信用風險：衍生工具採用標準（對手方信用風險）（「SA-CCR」）計算法，證券融資交易則採用認可抵押品的全面方法；
(c) 業務操作風險：標準計算法；
(d) 市場風險：標準(市場風險)計算法 (「STM 計算法」)；及
(e) 信用估值調整（「CVA」）風險：SA-CCR 資本要求數額。

如適用，作為未經審計季度財務披露報告一部分進行披露的模版及表格遵循香港金融管理局於《銀行業（披露）規則》下指定的標準披露模版及表格。其他不適用於 MSBAL 集團或於期間並無可列報金額的模版及表格則未予披露。

B. 主要審慎比率

模版 KM1：主要審慎比率

		MSBAL 集團				
		於 二零二六年 九月三十日	於 二零二六年 六月三十日	於 二零二六年 三月三十一日	於 二零二五年 十二月三十一日	於 二零二五年 九月三十日
		千美元	千美元	千美元	千美元	千美元
	監管資本（數額）					
1 及 1a	普通股權一級(「CET1」)	2,564,303	2,419,023	2,260,101	2,150,240	2,077,494
2 及 2a	一級	2,564,303	2,419,023	2,260,101	2,150,240	2,077,494
3 及 3a	總資本	2,602,009	2,457,288	2,291,881	2,179,210	2,105,251
	風險加權數額 (「RWA」)（數額）					
4	風險加權數額總額	6,414,844	6,119,086	5,401,145	4,922,926	4,931,732
4a	風險加權數額總額（下限前）[1]	6,414,844	6,119,086	5,401,145	4,922,926	4,931,732
	風險為本監管資本比率（以風險加權數額的百分率表示）					
5 及 5a	CET1 比率 (%)	40%	40%	42%	44%	42%
5b	CET1 比率 (%)（下限前比率）[1]	40%	40%	42%	44%	42%
6 及 6a	一級比率 (%)	40%	40%	42%	44%	42%
6b	一級比率 (%)（下限前比率）[1]	40%	40%	42%	44%	42%
7 及 7a	總資本比率 (%)	41%	40%	42%	44%	43%
7b	總資本比率 (%)（下限前比率）[1]	41%	40%	42%	44%	43%
	額外 CET1 緩衝要求（以風險加權數額的百分率表示）					
8	防護緩衝資本要求 (%)	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%
9	逆周期緩衝資本要求 (%)	0.266%	0.253%	0.245%	0.254%	0.285%
10	較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於 G-SIB 或 D-SIB)	0%	0%	0%	0%	0%
11	認可機構特定的總 CET1 緩衝要求 (%)	2.766%	2.753%	2.745%	2.754%	2.785%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的 CET1 (%)	33%	32%	34%	36%	35%
	《巴塞爾協定三》槓桿比率					
13	總槓桿比率(「LR」)風險承擔計量[2]	15,117,176	12,800,458	10,789,234	10,101,147	9,862,101
13a	以證券融資交易(「SFT」)資產總額平均值為基礎的槓桿比率風險承擔計量	13,413,364	12,795,435	11,051,899	10,220,672	10,104,054
14,14a 及 14b	槓桿比率 (%)	17%	19%	21%	21%	21%
14c 及 14d	以 SFT 資產總額平均值為基礎的槓桿比率 (%)	19%	19%	20%	21%	21%
	流動性維持比率(「LMR」)					
17a	LMR (%) [3]	70%	64%	64%	61%	62%
	核心資金比率(「CFR」)					
20a	CFR (%) [3]	130%	130%	133%	135%	138%

註 1: 由於出項下限的規定不適用於 MSBAL 集團，下限前和下限後情境下披露的數額相同。

註 2: 於二零二六年第三季度，總槓桿比率風險承擔計量增加主要由於由SFT產生的風險承擔總額增加。有關詳情請參閱 LR2 的註1。

註 3: 上表所披露 LMR 和 CFR 分別反映各季度內的三個公曆月平均 LMR 及平均 CFR 的算術平均數。根據《銀行業(流動性)規則》，MSBAL 集團無須就其流動性風險計算流動性覆蓋比率或穩定資金淨額比率。

C. 風險加權數額概覽

模版 OV1：風險加權數額概覽

		MSBAL 集團		
		風險加權數額		最低資本規定[1]
		於二零二六年九月三十日 千美元	於二零二六年六月三十日 千美元	於二零二六年九月三十日 千美元
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	4,631,308	4,446,046	370,505
2	其中標準(信用風險)計算法（「STC 計算法」）	4,631,308	4,446,046	370,505
2a	其中基本計算法（「BSC 計算法」）	-	-	-
3	其中基礎內部評級基準（「IRB」）計算法	-	-	-
4	其中監管分類準則計算法	-	-	-
5	其中高級 IRB 計算法	-	-	-
5a	其中零售 IRB 計算法	-	-	-
5b	其中特定風險權重計算法	-	-	-
5c	其中根據《資本規則》第 376 條及第 12 部第 5、6 及 8 分部計算的對信用風險的加密資產風險承擔	-	-	-
6	對手方信用風險及違責基金承擔	106,311	87,863	8,505
7	其中標準(對手方信用風險)（「SA-CCR」）計算法	77,004	53,852	6,160
7a	其中現行風險承擔方法（「CEM」）	-	-	-
8	其中內部模式(對手方信用風險)計算法（「IMM(CCR) 計算法」）	-	-	-
8a	其中適用於第 2b 組加密資產衍生工具合約的方法	-	-	-
9	其中其他	29,307	34,011	2,345
10	信用估值調整（「CVA」）風險	77,004	53,852	6,160
11	簡單風險權重方法及內部模式方法下的銀行帳內股權狀況	不適用	不適用	不適用
12	集體投資計劃（「CIS」）風險承擔－透視計算法（「LTA」）／第三方計算法	-	-	-
13	集體投資計劃風險承擔－授權基準計算法（「 MBA」）	-	-	-
14	集體投資計劃風險承擔－備選方法（「FBA」）	-	-	-
14a	集體投資計劃風險承擔 － 混合使用計算法	-	-	-
15	交收風險	-	-	-
16	銀行帳內的證券化類別風險承擔	-	-	-
17	其中證券化內部評級基準計算法（「SEC-IRBA」）	-	-	-
18	其中證券化外部評級基準計算法（「SEC-ERBA」）（包括內部評估計算法（「IAA」）	-	-	-
19	其中證券化標準計算法（「SEC-SA」）	-	-	-
19a	其中證券化備選法（「SEC-FBA」）	-	-	-
20	市場風險	298,326	316,127	23,866
21	其中標準(市場風險)計算法（「STM 計算法」）	298,326	316,127	23,866
22	其中內部模式計算法（「IMA 計算法」）	-	-	-
22a	其中簡化標準計算法（「SSTM 計算法」）	-	-	-
23	在交易帳與銀行帳之間調動風險承擔的資本要求	-	-	-
24	業務操作風險	1,285,419	1,215,198	102,834
24a	官方實體集中風險	16,476	-	1,318
25	低於扣減門檻的數額（須計算 250%風險權重（「RW」））	-	-	-
26	應用出項下限水平	-	-	
27	下限調整（應用過渡上限前）	-	-	
28	下限調整（應用過渡上限後）	不適用	不適用	不適用
28a	風險加權數額扣減	-	-	-
28b	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	-	-	-
28c	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	-	-	-
29	**總計**	**6,414,844**	**6,119,086**	**513,188**

註 1: 最低資本規定之披露按照相關計算法以 MSBAL 集團風險加權數額乘以 8%得出，並非 MSBAL 集團的實際「監管資本」。

D. 槓桿比率

模版 LR2：槓桿比率

		MSBAL 集團	
		於二零二六年九月三十日	於二零二六年六月三十日
		千美元	千美元
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內風險承擔（不包括由衍生工具合約或 SFT），但包括相關資產負債表內抵押品）	10,815,648	10,522,508
2	還原根據適用會計準則須從資產負債表資產中扣減的就衍生工具合約提供的抵押品數額	-	-
3	扣減：就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收項目資產的扣減	-	-
4	扣減：就 SFT 收到的並已確認為資產的證券作出的調整	-	-
5	扣減：從一級資本扣減的與資產負債表內風險承擔相關的特定準備金及集體準備金	(807)	(935)
6	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	(60,072)	(60,007)
7	**資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及 SFT）（第 1 至 6 行的總和）**	10,754,769	10,461,566
由衍生工具合約產生的風險承擔			
8	所有與衍生工具合約有關的重置成本（如適用的話，扣除合資格現金變動保證金及 / 或雙邊淨額結算）	79,046	157,585
9	所有與衍生工具合約有關的潛在未來風險承擔的附加額	207,584	121,485
10	扣減：中央交易對手方風險承擔中與客戶結算交易有關而獲豁免的部分	-	-
11	經調整後已出售信用關聯衍生工具合約的有效名義數額	-	-
12	扣減：就已出售信用關聯衍生工具合約的有效名義數額獲准的減少及潛在未來風險承擔的附加額獲准的扣減	-	-
13	**衍生工具合約產生的風險承擔總額（第 8 至 12 行的總和）**	286,630	279,070
由 SFT 產生的風險承擔			
14	經調整出售會計交易後（在不確認淨額計算下）的 SFT 資產總額	3,593,141	1,600,327
15	扣減：SFT 資產總額的現金應付額及現金應收額的可抵銷額	-	-
16	SFT 資產的對手方信用風險承擔	18,816	37,323
17	代理交易風險承擔	-	-
18	**由 SFT 產生的風險承擔總額（第 14 至 17 行的總和）** [1]	3,611,957	1,637,650
其他資產負債表外風險承擔			
19	資產負債表外風險承擔名義數額總額	4,638,140	4,221,665
20	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	(4,174,320)	(3,799,493)
21	扣減：從一級資本扣減的與資產負債表外風險承擔相關的特定準備金及集體準備金	-	-
22	**資產負債表外項目（第 19 至 21 行的總和）**	463,820	422,172
資本及風險承擔總額			
23	**一級資本**	2,564,303	2,419,023
24	**風險承擔總額（第 7、13、18 及 22 行的總和）** [1]	15,117,176	12,800,458
槓桿比率			
25 及 25a	**槓桿比率**	**17%**	**19%**
26	**最低槓桿比率規定**	**3%**	**3%**
27	**適用槓桿緩衝**	不適用	不適用
平均值披露			
28	SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）	1,889,329	1,595,304
29	SFT 資產總額季度終結值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）	3,593,141	1,600,327
30 及 30a	根據第 28 行填報的 SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）得出的風險承擔總額	13,413,364	12,795,435
31 及 31a	根據第 28 行填報的 SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）得出的槓桿比率	**19%**	**19%**

註 1: 於二零二六年第三季度，由 SFT 產生的風險承擔總額和風險承擔總額增加主要由於抵押融資增加。