

摩根士丹利亞洲國際有限公司

季度財務披露報告

二零一七年九月三十日

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
二零一七年九月三十日

| 目錄 | 頁次 |
|-----------------|----|
| 主要資本比率披露 | 1 |
| 模版 OV1：風險加權數額概覽 | 1 |

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

二零一七年九月三十日

1. 第三支柱披露

摩根士丹利亞洲國際有限公司（「本公司」）之資本充足率根據《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：標準(信用風險)計算法（「STC計算法」）；及
- (b) 業務操作風險：基本指標計算法（「BIA計算法」）。

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。

a. 主要資本比率披露

| | 於二零一七年 九月三十日 千美元 |
|---------------------|------------------------|
| 資本充足率 | |
| 普通股權一級資本（「CET1 資本」） | 215,856 |
| 一級資本 | 215,856 |
| 總資本 | 223,229 |
| 總風險加權數額 | 1,024,216 |
| | |
| CET1 資本比率 | 21% |
| 一級資本比率 | 21% |
| 總資本比率 | 22% |
| | |
| | 於二零一七年 九月三十日 千美元 |
| 槓桿比率 | |
| 一級資本 | 215,856 |
| 風險承擔總額 | 4,705,903 |
| | |
| 槓桿比率 | 4.59% |

b. 模版 OV1：風險加權數額概覽

下表為根據《銀行業（披露）規則》所規定的第三支柱披露，按香港金融管理局指定的標準披露模版顯示。其他未有作出披露的模版為不適用於本公司或於期內並無可呈報金額。

二零一七年第三季度的總風險加權數額增加 125,975,000 美元。增加的主要因為（a）向客戶提供貸款及墊款，而導致非證券化類別風險承擔的信用風險的風險加權數額增加，及（b）包含於計算中的最近三個年度之平均總收入較高，而導致業務操作風險的風險加權數額增加。這是由於由二零一七年第三季度起，當本公司已營運兩年六個月或以上，但少於三年，計算業務操作風險時須將最早年度的總收入按年率計算。

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

二零一七年九月三十日

1. 第三支柱披露 (續)

b. 模版 OV1：風險加權數額概覽 (續)

| | | 風險加權數額 | | 最低資本規定 |
|-----|--|------------------------|------------------------|------------------------|
| | | 於二零一七年 九月三十日 千美元 | 於二零一七年 六月三十日 千美元 | 於二零一七年 九月三十日 千美元 |
| 1 | 非證券化類別風險承擔的信用風險 | 585,142 | 497,243 | 46,811 |
| 2 | 其中標準(信用風險)計算法(「STC 計算法」) | 585,142 | 497,243 | 46,811 |
| 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 | 6,728 | 6,225 | 538 |
| 5 | 其中現行風險承擔方法 | 4,625 | 4,281 | 370 |
| 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 | 432,358 | 395,432 | 34,589 |
| 20 | 其中基本指標計算法(「BIA 計算法」) | 432,358 | 395,432 | 34,589 |
| 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 | 12 | 659 | 1 |
| 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 | 12 | 659 | 1 |
| 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 | 1,024,216 | 898,241 | 81,937 |

N/A：不適用於香港情況

最低資本規定之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」。