

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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

二零一九年九月三十日

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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
二零一九年九月三十日

| 目錄 | 頁次 |
|-----------------|----|
| 模版 KM1：主要審慎比率 | 1 |
| 模版 OV1：風險加權數額概覽 | 2 |
| 模版 LR2：槓桿比率 | 4 |

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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
二零一九年九月三十日

1. 第三支柱披露

以下模版為摩根士丹利銀行亞洲有限公司(「本公司」)，前稱「摩根士丹利亞洲國際有限公司」，就《銀行業(披露)規則》所規定的第三支柱披露載列香港金融管理局指定的標準披露模版。

並無於下文披露的其他第三支柱模版或表格，不適用於本公司或於期間並無可列報金額。

a. 模版 KM1：主要審慎比率

| | | 於 二零一九年 九月三十日 | 於 二零一九年 六月三十日 | 於 二零一九年 三月三十一日 | 於 二零一八年 十二月三十一日 | 於 二零一八年 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 | 普通股權一級(「CET1」) | 846,872 | 825,606 | 808,927 | 287,225 | 273,366 |
| 2 | 一級 | 846,872 | 825,606 | 808,927 | 287,225 | 273,366 |
| 3 | 總資本 | 865,340 | 839,228 | 819,045 | 295,717 | 280,931 |
| 風險加權數額(「RWA」)(數額) | | | | | | |
| 4 | 風險加權數額總額 | 2,016,322 | 1,600,787 | 1,295,339 | 1,135,987 | 1,047,309 |
| 風險為本監管資本比率(以風險加權數額的百分率表示) | | | | | | |
| 5 | CET1 比率(%) | 42% | 52% | 62% | 25% | 26% |
| 6 | 一級比率(%) | 42% | 52% | 62% | 25% | 26% |
| 7 | 總資本比率(%) | 43% | 52% | 63% | 26% | 27% |
| 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% | 1.875% | 1.875% |
| 9 | 逆周期緩衝資本要求(%) | 1.128% | 1.124% | 1.072% | 0.935% | 0.772% |
| 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(%) | 3.628% | 3.624% | 3.572% | 2.810% | 2.647% |
| 12 | 符合認可機構的最低資本 規定後可用的 CET1(%) | 35% | 44% | 55% | 18% | 19% |
| 《巴塞爾協定三》槓桿比率 | | | | | | |
| 13 | 總槓桿比率(「LR」) 風險承擔計量 | 4,642,609 | 4,205,381 | 4,517,029 | 3,443,511 | 3,867,740 |
| 14 | LR(%) | 18% | 20% | 18% | 8% | 7% |
| 流動性維持比率(「LMR」) | | | | | | |
| 17a | LMR(%) ⁽¹⁾ | 62% | 62% | 55% | 61% | 60% |
| 核心資金比率(「CFR」) | | | | | | |
| 20a | CFR(%) ⁽¹⁾ | 236% | 251% | 239% | 240% | 247% |

註 1: 上表所披露 LMR 和 CFR 分別反映各季度內的 3 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》，本公司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。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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
二零一九年九月三十日

1. 第三支柱披露 (續)

b. 模版 OV1：風險加權數額概覽

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，故本公司沒有市場風險的風險加權數額。

最低資本規定之披露按照相關計算法以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」。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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
二零一九年九月三十日

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 |
|-----|--|-----------------|-----------------|-----------------|
| | | 於二零一九年 九月三十日 | 於二零一九年 六月三十日 | 於二零一九年 九月三十日 |
| | | 千美元 | 千美元 | 千美元 |
| 1 | 非證券化類別風險承擔的信用風險 | 1,471,893 | 1,084,677 | 117,752 |
| 2 | 其中 STC 計算法 | 1,471,893 | 1,084,677 | 117,752 |
| 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 | - | - | - |
| 6 | 對手方違責風險及違責基金承擔 | 5,571 | 5,106 | 446 |
| 7 | 其中對手方信用風險標準計算法 (「SA-CCR」) | 不適用 | | |
| 7a | 其中現行風險承擔方法 (「CEM」) | 4,239 | 2,516 | 339 |
| 8 | 其中內部模式 (對手方信用風險計算法 (「IMM(CCR) 計算法」)) | - | - | - |
| 9 | 其中其他 | 1,332 | 2,590 | 107 |
| 10 | 信用估值調整 (「CVA」) 風險 | 1,926 | 1,144 | 154 |
| 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 | - | - | - |
| 12 | 集體投資計劃風險承擔 - 推論法 (「LTA」) | 不適用 | | |
| 13 | 集體投資計劃風險承擔 - 委託基礎法 (「MBA」) | 不適用 | | |
| 14 | 集體投資計劃風險承擔 - 備選法 (「FBA」) | 不適用 | | |
| 14a | 集體投資計劃風險承擔 - 混合使用計算法 | 不適用 | | |
| 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 | - | - | - |
| 21 | 其中標準 (市場風險) 計算法 (「STM 計算法」) | - | - | - |
| 22 | 其中內部模式計算法 (「IMM 計算法」) | - | - | - |
| 23 | 交易帳與銀行帳之間切換的風險承擔的資本要求 (經修訂 市場風險框架生效前不適用) | 不適用 | | |
| 24 | 業務操作風險 | 544,016 | 519,071 | 43,521 |
| 24a | 官方實體集中風險 | - | - | - |
| 25 | 低於扣減門檻的數額 (須計算 250% 風險權重 (「RW」)) | - | - | - |
| 26 | 資本下限調整 | - | - | - |
| 26a | 風險加權數額扣減 | 7,084 | 9,211 | 567 |
| 26b | 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 | 7,084 | 9,211 | 567 |
| 26c | 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 | - | - | - |
| 27 | 總計 | 2,016,322 | 1,600,787 | 161,306 |

二零一九年第三季度的 RWA 總額增加 415,535,000 美元。主因是予客戶之貸款及墊款增加，導致非證券化風險的信用風險 RWA 增加。

本報告為其英文版之摘錄版，如與英文版有歧異，則以英文版為準。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
(前稱「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
二零一九年九月三十日

1. 第三支柱披露 (續)

b. 模版 LR2：槓桿比率

| | | 於 二零一九年 九月三十日 | 於 二零一九年 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證券融資交易(SFT)產生的風險承擔, 但包括抵押品) | 3,918,018 | 3,414,566 |
| 2 | 扣減: 斷定一級資本時所扣減的資產數額 | (29,410) | (26,096) |
| 3 | 資產負債表內風險承擔總額 (不包括衍生工具合約及 SFT) | 3,888,608 | 3,388,470 |
| 由衍生工具合約產生的風險承擔 | | | |
| 4 | 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) | 1,793 | - |
| 5 | 所有與衍生工具合約有關的潛在未來風險承擔的附加數額 | 8,336 | 5,031 |
| 6 | 還原因提供予對手方而須根據適用會計框架從資產負債表中扣減的衍生工具抵押品的數額 | - | - |
| 7 | 扣減: 就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收部分 | - | - |
| 8 | 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 | - | - |
| 9 | 經調整後已出售信用衍生工具合約的有效名義數額 | - | - |
| 10 | 扣減: 就已出售信用衍生工具合約作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減 | - | - |
| 11 | 衍生工具合約產生的風險承擔總額 | 10,129 | 5,031 |
| 由SFT產生的風險承擔 | | | |
| 12 | 經銷售會計交易調整後 (在不確認淨額計算下) 的 SFT 資產總計 | 741,959 | 807,512 |
| 13 | 扣減: SFT 資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額 | - | - |
| 14 | SFT 資產的對手方信用風險承擔 | 1,913 | 4,368 |
| 15 | 代理交易風險承擔 | - | - |
| 16 | 由 SFT 產生的風險承擔總額 | 743,872 | 811,880 |
| 其他資產負債表外風險承擔 | | | |
| 17 | 資產負債表外風險承擔名義數額總額 | - | - |
| 18 | 扣減: 就轉換為信貸等值數額作出的調整 | - | - |
| 19 | 資產負債表外項目 | - | - |
| 資本及風險承擔總額 | | | |
| 20 | 一級資本 | 846,872 | 825,606 |
| 20a | 為特定準備金及集體準備金作出調整前的風險承擔總額 | 4,642,609 | 4,205,381 |
| 20b | 為特定準備金及集體準備金作出的調整 | - | - |
| 21 | 為特定準備金及集體準備金作出調整後的風險承擔總額 | 4,642,609 | 4,205,381 |
| 槓桿比率 | | | |
| 22 | 槓桿比率 | 18% | 20% |

二零一九年第三季度內槓桿比率下跌主要是由於存款於截至二零一九年九月三十日止季度內增加導致總資產負債表內風險承擔增加。

本報告為其英文版之摘錄版, 如與英文版有歧異, 則以英文版為準。