

摩根士丹利亞洲國際有限公司

季度財務披露報告

二零一八年三月三十一日

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
二零一八年三月三十一日

目錄	頁次
主要資本比率披露	1
模版 OV1：風險加權數額概覽	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

二零一八年三月三十一日

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，故本公司沒有市場風險的風險加權數額（「RWA」）。

以下模版及表格就《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及表格。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. 主要資本比率披露

	於二零一八年 三月三十一日 千美元
資本充足率	
普通股權一級（「CET1」）資本	232,685
一級資本	232,685
總資本	239,638
總風險加權數額	987,955
CET1 資本比率	24%
一級資本比率	24%
總資本比率	24%
	於二零一八年 三月三十一日 千美元
槓桿比率	
一級資本	232,685
風險承擔總額	4,423,128
槓桿比率	5.26%

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

二零一八年三月三十一日

1. 第三支柱披露(續)

b. 模版 OV1：風險加權數額概覽

		風險加權數額		最低資本規定
		於二零一八年 三月三十一日 千美元	於二零一七年 十二月三十一日 千美元	於二零一八年 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	551,650	521,976	44,132
2	其中標準(信用風險)計算法(「STC 計算法」)	551,650	521,976	44,132
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	6,610	6,376	529
5	其中現行風險承擔方法(「CEM」)	4,544	4,384	364
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	其中證券化內部評級基準計算法(「SEC-IRBA」)	-	-	-
14	其中證券化外部評級基準計算法(「SEC-ERBA」)	-	-	-
15	其中證券化標準計算法(「SEC-SA」)	-	-	-
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	440,021	426,492	35,202
20	其中基本指標計算法(「BIA 計算法」)	440,021	426,492	35,202
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	10,326	572	826
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	10,326	572	826
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	987,955	954,272	79,037

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」。