

歐力士(亞洲)有限公司(本公司)

模版 OV1：風險加權數額概覽於二零一七年六月三十日(未經審核)

目的：	藉提供風險加權數額的詳細細目分類，概述各類風險的資本規定。
適用範圍：	所有在香港成立為法團的認可機構均須填報本模版。
內容：	第一支柱框架下的風險加權數額及資本規定。
頻密程度：	每季一次。
格式：	固定。
附加說明：	<p>下表提供以風險類別劃分的風險加權數額及相關最低資本規定的概覽。本公司採用《基本計算法》計算信用風險的風險加權數，採用《現行風險承擔方法》計算對手方信用風險及《基本指標計算法》計算業務操作風險的風險加權數。</p> <p>於二零一七年三月三十一日年度內及截至二零一七年六月三十日，買賣賬所產生之市場風險很輕微。本公司根據金管局發出之《銀行業（資本）規則》第 22(1)(a)及(b)條所規定，符合豁免要求。因此，本公司可獲豁免申報市場風險之計算。</p>
《披露規則》相應條文：	16C

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		二零一七年 六月三十日 港幣千元	二零一七年 三月三十一日 港幣千元	二零一七年 六月三十日 港幣千元
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	<b>6,461,888</b>	<b>6,617,915</b>	<b>516,951</b>
2	其中 STC 計算法			
2a	其中 BSC 計算法	6,461,888	6,617,915	516,951
3	其中 IRB 計算法			
4	對手方信用風險	<b>4,338</b>	<b>3,263</b>	<b>347</b>
5	其中 SA-CCR 計算法			
5a	其中現行風險承擔方法	4,338	3,263	347
6	其中 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			

歐力士(亞洲)有限公司

模版 OV1：風險加權數額概覽 於二零一七年六月三十日(未經審核)(續)

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		二零一七年 六月三十日 港幣千元	二零一七年 三月三十一日 港幣千元	二零一七年 六月三十日 港幣千元
11	交收風險			
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔 <sup>1</sup>			
13	其中 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 STC(S)計算法			
16	市場風險			
17	其中 STM 計算法			
18	其中 IMM 計算法			
19	業務操作風險	<b>325,163</b>	<b>315,325</b>	<b>26,013</b>
20	其中 BIA 計算法	325,163	315,325	26,013
21	其中 STO 計算法			
21a	其中 ASA 計算法			
22	其中 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	<b>4,119</b>	<b>3,982</b>	<b>329</b>
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	4,119	3,982	329
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	<b>6,787,270</b>	<b>6,932,521</b>	<b>542,982</b>

N/A：不適用於香港情況

<sup>1</sup>應注意，當經修訂證券化框架於 2018 年 1 月生效後，第 13、14 及 15 行應修訂如下：(i) IRB(S)計算法 – 評級基準方法應由 SEC-IRBA 計算法\*取代；(ii) IRB(S)計算法 – 監管公式方法應由 SEC-ERBA 計算法\*取代；以及(iii) STC(S)計算法應由 SEC-SA 計算法\*取代。如 SEC-FBA 計算法\*適用，可於第 15 行之下添加一新行（例如第 15a 行）。（\* 所有名稱及計算法均視乎《資本規則》的最終修訂而定）

歐力士(亞洲)有限公司

主要資本比率披露截至 2017 年 6 月 30 日

資本充足比率(單獨基礎)	參照提示	港幣千元	
		2017 年 6 月 30 日	2017 年 3 月 31 日
<b>資本基礎及風險加權資產值</b>			
-普通股權一級資本	[甲]	2,010,184	1,979,599
-一級資本	[乙]	2,010,184	1,979,599
-總資本	[丙]	2,090,958	2,062,323
-風險加權資產總值	[丁]	6,787,270	6,932,521
<b>資本充足比率</b>			
-普通股權一級資本比率	[甲]/[丁]	29.6170%	28.5553%
-一級資本比率	[乙]/[丁]	29.6170%	28.5553%
-總資本比率	[丙]/[丁]	30.8071%	29.7485%

槓桿比率(合併)	參照提示	港幣千元	
		2017 年 6 月 30 日	2017 年 3 月 31 日
<b>資本計量值及風險承擔計量值</b>			
-一級資本	[乙]	2,010,184	1,979,599
-風險承擔計量總值	[戊]	6,894,971	7,004,369
<b>槓桿比率</b>			
	[乙]/[戊]	29.15%	28.26%