

歐力士(亞洲)有限公司
監管披露報表季度截至二零一八年六月三十日止(未經審核)

歐力士(亞洲)有限公司

監管披露報表

季度截至二零一八年六月三十日

(未經審核)

目錄	頁數
1. 引言	3
2. 主要資本比率	4
3. 風險加權數額概覽(“RWA”)	
模版 OV1：風險加權數額概覽	5

1. 引言

目的

本文所載為歐力士(亞洲)有限公司(「本公司」)的資料，符合《銀行業(披露)規則》。

編製基準

本公司採用《基本計算法》計算信用風險的風險加權數及《基本指標計算法》計算業務操作風險的風險加權數。

於二零一八年三月三十一日年度內及季度截至二零一八年六月三十日止，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。

主要業務

本公司之主要業務為向工業、商業及個人客戶提供租賃設備融資及分期還款合約，同時亦從事債務證券及股份證券投資。

本公司為一間受香港《銀行業條例》管制之有限制持牌銀行，同時亦是香港按揭證券有限公司之核准賣商/服務商。

歐力士(亞洲)有限公司
監管披露報表季度截至二零一八年六月三十日止(未經審核)

2. 主要資本比率

資本充足比率 (單獨基礎)

	參照提示	二零一八年 六月三十日 (美元)	二零一八年 三月三十一日 (美元)
資本基礎及風險加權資產值			
-普通股權一級資本	[A]	266,624,479	264,285,046
-一級資本	[B]	266,624,479	264,285,046
-總資本	[C]	275,778,051	273,862,369
-風險加權資產總值	[D]	778,230,519	811,330,203
資本充足比率			
-普通股權一級資本比率	[A]/[D]	34.2603%	32.5743%
-一級資本比率	[B]/[D]	34.2603%	32.5743%
-總資本比率	[C]/[D]	35.4366%	33.7547%

槓桿比率 (合併)

	參照提示	二零一八年 六月三十日 (美元)	二零一八年 三月三十一日 (美元)
資本計量值及風險承擔計量值			
-一級資本	[B]	266,624,479	264,285,046
-風險承擔計量總值	[E]	789,291,858	828,359,964
槓桿比率	[B]/[E]	33.78%	31.90%

3. 風險加權數額概覽(“RWA”)

模版 OV1：風險加權數額概覽

下表提供分別於二零一八年六月三十日及二零一八年三月三十一日的風險加權數額的詳細細目分類，以概述各類風險的資本規定：

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		二零一八年 六月三十日 (美元)	二零一八年 三月三十一日 (美元)	二零一八年 六月三十日 (美元)
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	731,732,393	765,517,869	58,538,591
2	其中 STC 計算法			
2a	其中 BSC 計算法	731,732,393	765,517,869	58,538,591
3	其中 IRB 計算法			
4	對手方信用風險	970,825	1,183,053	77,666
5	其中 SA-CCR 計算法			
5a	其中現行風險承擔方法	553,387	667,978	44,271
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			
11	交收風險			
12	銀行帳內的證券化類別風險承擔			
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	46,108,880	45,200,729	3,688,710
20	其中 BIA 計算法	46,108,880	45,200,729	3,688,710
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	581,579	571,448	46,526
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	581,579	571,448	46,526
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	778,230,519	811,330,203	62,258,441

N/A：不適用於香港情況