

歐力士(亞洲)有限公司
監管披露報表季度截至二零一七年十二月三十一日止(未經審核)

歐力士(亞洲)有限公司

監管披露報表

季度截至二零一七年十二月三十一日

(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。

於二零一七年三月三十一日年度內及季度截至二零一七年十二月三十一日止，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。

歐力士(亞洲)有限公司
 監管披露報表季度截至二零一七年十二月三十一日止(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	二零一七年 十二月三十一日 (美元)	二零一七年 九月三十日 (美元)
資本基礎及風險加權資產值			
-普通股權一級資本	[A]	262,909,486	260,112,770
-一級資本	[B]	262,909,486	260,112,770
-總資本	[C]	272,574,266	270,117,564
-風險加權資產總值	[D]	817,543,714	843,351,264
資本充足比率			
-普通股權一級資本比率	[A]/[D]	32.1585%	30.8428%
-一級資本比率	[B]/[D]	32.1585%	30.8428%
-總資本比率	[C]/[D]	33.3406%	32.0291%

槓桿比率 (合併)

	參照提示	二零一七年 十二月三十一日 (美元)	二零一七年 九月三十日 (美元)
資本計量值及風險承擔計量值			
-一級資本	[B]	262,909,486	260,112,770
-風險承擔計量總值	[E]	830,899,880	870,834,121
槓桿比率			
	[B]/[E]	31.64%	29.87%

歐力士(亞洲)有限公司
監管披露報表季度截至二零一七年十二月三十一日止(未經審核)

3. 風險加權數額概覽(“RWA”)

模版 OV1：風險加權數額概覽

下表提供分別於二零一七年十二月三十一日及二零一七年九月三十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
		二零一七年 十二月三十一日 (美元)	二零一七年 九月三十日 (美元)	二零一七年 十二月三十一日 (美元)
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	772,589,756	799,775,145	61,807,180
2	其中 STC 計算法			
2a	其中 BSC 計算法	772,589,756	799,775,145	61,807,180
3	其中 IRB 計算法			
4	對手方信用風險	1,049,552	1,070,298	83,964
5	其中 SA-CCR 計算法			
5a	其中現行風險承擔方法	592,664	608,398	47,413
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	44,465,942	43,049,717	3,557,275
20	其中 BIA 計算法	44,465,942	43,049,717	3,557,275
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	561,536	543,896	44,923
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	561,536	543,896	44,923
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	817,543,714	843,351,264	65,403,497

N/A：不適用於香港情況