

Banc of America Securities Asia Limited

季度披露報表

截至二零一七年九月三十日止

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

未經審核之資料

主要資本披露

(一) 資本充足比率

下列表概述本公司的各比率。

	二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算
普通股權一級資本比率	298.35%	482.10%
一級資本比率	298.35%	482.10%
資本總額比率	298.35%	482.10%

計算上述資本充足比率時使用的資本基礎及風險加權數額總結如下：

	二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算
		千美元
資本基礎:		
普通股權一級資本	537,279	265,088
一級資本	537,279	265,088
資本總額	537,279	265,088
風險加權數額總額	180,082	54,986

(二) 槓桿比率

	二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算
槓桿比率	94.86%	99.66%

計算上述槓桿比率時使用的資本及風險承擔計量總額總結如下：

	二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算
		千美元
一級資本	537,279	265,088
風險承擔計量總額	566,406	265,989

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

未經審核之資料

主要資本披露(續)

總資本比率相比上季度有所減少，主要來自非證券化類別風險承擔的信用風險的增加。而當中主要由美金 2.71 億元的資本注入引起的資產規模變動所致。

風險加權數額概覽

本公司之風險加權數額細分如下。

按照香港金融管理局所發出之《銀行業（資本）規則》，本公司採納「標準（信用風險）計算法」計算信貸風險之風險加權資產，以及採用「基本指標計算法」計算業務操作風險。

本公司獲香港金融管理局豁免計算於資本規則第17條所列載的市場風險。

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算	二零一七年 九月三十日 結算
		千美元		
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	176,663	53,193	14,133
2	其中 STC 計算法	176,663	53,193	14,133
2a	其中 BSC 計算法	-	-	-
3	其中 IRB 計算法	-	-	-
4	對手方信用風險	897	17	72
5	其中 SA-CCR 計算法	-	-	-
5a	其中現行風險承擔方法	617	12	49
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	2,522	1,776	202
20	其中 BIA 計算法	2,522	1,776	202

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

未經審核之資料

風險加權數額概覽 (續)

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		二零一七年 九月三十日 結算	二零一七年 六月三十日 結算	二零一七年 九月三十日 結算
		千美元		
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)	32,428	-	2,594
24	資本下限調整	-	-	-
24a	風險加權數額扣減	-	-	-
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	-	-	-
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	180,082	54,986	14,407
N/A : 不適用於香港情況				

總計風險加權數額於 2017 年第二季度上升美金 1.25 億元, 主要增加來自非證券化類別風險承擔的信用風險。而當中主要由美金 2.71 億元的資本注入引起的資產規模變動所致。