

摩根士丹利銀行亞洲有限公司

未經審計季度財務披露報告

二零二二年九月三十日

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二二年九月三十日

目錄	頁次
公司資料	1
編製基準	1
模版 KM1：主要審慎比率	2
模版 OV1：風險加權數額概覽	3
模版 LR2：槓桿比率	4

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二二年九月三十日

1. 第三支柱披露

公司資料

摩根士丹利銀行亞洲有限公司（「MSBAL」，或「本公司」）為一間於香港註冊成立的私人有限公司，擁有設於香港的總辦事處及設於新加坡的分行。

於二零二二年三月十五日，本公司以現金代價 260,000,000 美元向摩根士丹利香港 1238 有限公司（「MSHK1238」）發行 260,000,000 股普通股（「資本注入」）。

於二零二二年三月二十九日，本公司以代價 262,347,618 美元向摩根士丹利國際銀行有限公司（「MSBIL」）收購摩根士丹利國際銀行（中國）有限公司（「MSBIC」，或「附屬公司」）的全部普通股（「收購」）。於收購後，MSBAL 連同其附屬公司組成 MSBAL 集團（「本集團」）。

編製基準

第三支柱披露是根據《銀行業（披露）規則》而編製。於完成收購 MSBIC 後，香港金融管理局要求本公司按綜合基礎計算其資本充足比率。根據《銀行業（披露）規則》，由二零二二年三月三十一日的報告期開始，除另有註明外，此披露報告所載的財務資料乃按綜合基準編製（即包括本公司的附屬公司的業務）。於二零二一年十二月三十一日或之前（即收購前）的報告期，財務資料只包括本公司的業務。

本公司及本集團（如適用）之資本充足率根據《銀行業（資本）規則》計算。以下計算法受採用以計算其資本要求：

- (a) 信用風險：標準（信用風險）計算法（「STC計算法」）；
- (b) 對手方信用風險：標準（對手方信用風險）計算法（「SA-CCR」計算法）；
- (c) 業務操作風險：基本指標計算法（「BIA 計算法」）；及
- (d) 市場風險：標準（市場風險）計算法（「STM計算法」）⁽¹⁾。

註1：適用於二零二二年三月三十一日或以後的報告期。

於二零二一年十二月三十一日或之前的報告期，因香港金融管理局豁免本公司計算市場風險，故本公司沒有市場風險的風險加權數額。於收購完成後，因本集團不再滿足《銀行業（資本）規則》豁免計算市場風險所要求的門檻及條件，香港金融管理局撤銷此豁免。因此，本集團由二零二二年三月三十一日的報告期開始計算市場風險之風險加權數額。

此披露報告載列於香港金融管理局於《銀行業（披露）規則》下指定的第三支柱披露的標準披露模版。其他並無於下文披露的第三支柱模版或表格，不適用於本公司及本集團或於期間並無可列報金額。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二二年九月三十日

1. 第三支柱披露(續)

a. 模板 KM1：主要審慎比率

		本集團			本公司	
		於 二零二二年 九月三十日	於 二零二二年 六月三十日	於 二零二二年 三月三十一日	於 二零二一年 十二月三十一日	於 二零二一年 九月三十日
		千美元	千美元	千美元	千美元	千美元
監管資本 (數額)						
1	普通股權一級(「CET1」)	1,459,364	1,430,636	1,409,697	1,133,128	1,098,634
2	一級	1,459,364	1,430,636	1,409,697	1,133,128	1,098,634
3	總資本	1,473,938	1,443,836	1,426,854	1,149,042	1,119,380
風險加權數額 (數額)						
4	風險加權數額總額 ⁽¹⁾	2,165,505	2,038,196	2,391,293	2,149,094	2,543,315
風險為本監管資本比率 (以風險加權數額的百分率表示)						
5	CET1 比率 (%)	67%	71%	59%	53%	43%
6	一級比率 (%)	67%	71%	59%	53%	43%
7	總資本比率 (%) ⁽¹⁾	68%	71%	60%	53%	44%
額外 CET1 緩衝要求 (以風險加權數額的百分率表示)						
8	防護緩衝資本要求 (%)	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%	2.500%
9	逆周期緩衝資本要求 (%)	0.416%	0.379%	0.393%	0.473%	0.481%
10	較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於 G-SIB 或 D-SIB)	0%	0%	0%	0%	0%
11	認可機構特定的總 CET1 緩衝要求 (%)	2.916%	2.879%	2.893%	2.973%	2.981%
12	符合認可機構的最低資本 規定後可用的 CET1 (%)	60%	63%	52%	45%	36%
《巴塞爾協定三》槓桿比率						
13	總槓桿比率(「LR」) 風險承擔計量 ⁽²⁾	7,784,942	9,236,779	10,572,757	9,875,839	10,631,640
14	LR (%) ⁽²⁾	19%	16%	13%	11%	10%
流動性維持比率(「LMR」)						
17a	LMR (%) ⁽³⁾	67%	70%	69%	67%	66%
核心資金比率(「CFR」)						
20a	CFR (%) ⁽³⁾	265%	295%	260%	235%	225%

註 1：總資本比率在二零二二年第三季度減少主要由於風險加權數額增加所致。詳情見模板 OV1。

註 2：槓桿比率在二零二二年第三季度增加主要由於資產負債表內風險承擔減少所致。詳情見模板 LR2。

註 3：上表所披露的 LMR 和 CFR 分別反映各季度內的 3 個公曆月平均 LMR 及平均 CFR 的算術平均數。根據《銀行業(流動性)規則》，本公司無須就其流動性風險計算流動性覆蓋比率或穩定資金淨額比率。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二二年九月三十日

1. 第三支柱披露(續)

b. 模版 OV1：風險加權數額概覽

		本集團		本集團
		風險加權數額		最低資本規定 ⁽¹⁾
		於二零二二年 九月三十日 千美元	於二零二二年 六月三十日 千美元	於二零二二年 九月三十日 千美元
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	1,129,009	1,007,639	90,321
2	其中標準(信用風險)計算法(「STC 計算法」)	1,129,009	1,007,639	90,321
2a	其中基本計算法(「BSC 計算法」)	-	-	-
3	其中基礎內部評級基準(「IRB」)計算法	-	-	-
4	其中監管分類準則計算法	-	-	-
5	其中高級 IRB 計算法	-	-	-
6	對手方違責風險及違責基金承擔	36,971	48,352	2,958
7	其中標準(對手方信用風險)(「SA-CCR」)計算法	7,839	25,010	627
7a	其中現行風險承擔方法(「CEM」)	-	-	-
8	其中內部模式(對手方信用風險)計算法(「IMM(CCR)計算法」)	-	-	-
9	其中其他	29,132	23,342	2,331
10	信用估值調整(「CVA」)風險	6,054	10,795	484
11	簡單風險權重方法及內部模式方法下的銀行帳內股權狀況	-	-	-
12	集體投資計劃風險承擔 – 推論法(「LTA」)	-	不適用	-
13	集體投資計劃風險承擔 – 委託基礎法(「MBA」)	-	不適用	-
14	集體投資計劃風險承擔 – 備選法(「FBA」)	-	不適用	-
14a	集體投資計劃風險承擔 – 混合使用計算法	-	不適用	-
15	交收風險	-	-	-
16	銀行帳內的證券化類別風險承擔	-	-	-
17	其中證券化內部評級基準計算法(「SEC-IRBA」)	-	-	-
18	其中證券化外部評級基準計算法(「SEC-ERBA」) (包括內部評估計算法(「IAA」))	-	-	-
19	其中證券化標準計算法(「SEC-SA」)	-	-	-
19a	其中證券化備選法(「SEC-FBA」)	-	-	-
20	市場風險	62,200	47,051	4,976
21	其中標準(市場風險)計算法(「STM 計算法」)	62,200	47,051	4,976
22	其中內部模式計算法(「IMM 計算法」)	-	-	-
23	交易帳與銀行帳之間切換的風險承擔的資本要求 (經修訂市場風險框架生效前不適用)	不適用		
24	業務操作風險	922,591	896,565	73,807
24a	主權集中度風險	9,847	30,340	788
25	低於扣減門檻的數額(須計算 250% 風險權重(「RW」))	-	-	-
26	資本下限調整	-	-	-
26a	風險加權數額扣減	1,167	2,546	93
26b	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	1,167	2,546	93
26c	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	-	-	-
27	總計	2,165,505	2,038,196	173,241

註 1：最低資本規定之披露按照相關計算法以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」。

註 2：風險加權數額在二零二二年第三季度增加 127,309,000 美元，主要由於貸款及墊款產生的非證券化類別風險承擔的信用風險加權數額增加。

摩根士丹利銀行亞洲有限公司
未經審計季度財務披露報告
二零二二年九月三十日

1. 第三支柱披露(續)

c. 模版 LR2：槓桿比率

		本集團	
		於 二零二二年 九月三十日	於 二零二二年 六月三十日
		千美元	千美元
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內風險承擔（不包括由衍生工具合約或證券融資交易（「SFT」）產生的風險承擔，但包括抵押品） ⁽¹⁾	4,472,736	6,215,144
2	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	(26,744)	(27,255)
3	資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及 SFT）	4,445,992	6,187,889
由衍生工具合約產生的風險承擔			
4	所有與衍生工具合約有關的重置成本（如適用的話，扣除合資格現金變動保證金及 / 或雙邊淨額結算）	10,039	116,228
5	所有與衍生工具合約有關的潛在未來風險承擔的附加數額	32,485	54,553
6	還原因提供予對手方而須根據適用會計框架從資產負債表中扣減的衍生工具合約抵押品的數額	-	-
7	扣減：就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收部分	-	-
8	扣減：中央交易對手方風險承擔中與客戶結算交易有關而獲豁免的部分	-	-
9	經調整後已出售信用關聯衍生工具合約的有效名義數額	-	-
10	扣減：就已出售信用關聯衍生工具合約作出調整的有效名義抵銷及附加數額的扣減	-	-
11	衍生工具合約產生的風險承擔總額	42,524	170,781
由SFT產生的風險承擔			
12	經銷售會計交易調整後（在不確認淨額計算下）的 SFT 資產總計 ⁽¹⁾	3,290,579	2,877,258
13	扣減：SFT 資產總計的應付現金與應收現金相抵後的淨額	-	-
14	SFT 資產的對手方信用風險承擔	6,338	1,617
15	代理交易風險承擔	-	-
16	由 SFT 產生的風險承擔總額	3,296,917	2,878,875
其他資產負債表外風險承擔			
17	資產負債表外風險承擔名義數額總額	-	-
18	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	-	-
19	資產負債表外項目	-	-
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	1,459,364	1,430,636
20a	為特定準備金及集體準備金作出調整前的風險承擔總額	7,785,433	9,237,545
20b	為特定準備金及集體準備金作出的調整	(491)	(766)
21	為特定準備金及集體準備金作出調整後的風險承擔總額⁽¹⁾	7,784,942	9,236,779
槓桿比率			
22	槓桿比率	19%	16%

註 1：風險承擔總額在二零二二年第三季度減少，主要由於 (a) 現金及短期存款以及投資證券（包含在「資產負債表內風險承擔」）的減少，被 (b) 貸款及墊款（包含在「資產負債表內風險承擔」）以及抵押融資（包含在「SFT 資產總計」）的增加部分抵銷。

SFT 資產總計增加主要由於投資證券減少，為本公司的流動資金管理的一部分。