J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED

根據《銀行業（披露）規則》編製季度監管披露

2026 年 9 月 30 日

J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED (未經審核)

1 主要審慎比率

主要審慎比率遵循銀行業(披露)規則第 16AB 條有關要求披露（除另有註明外，以千美元列述）。

		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日	2026 年 3 月 31 日	2025 年 12 月 31 日	2025 年 9 月 30 日
	監管資本（數額）					
1 及 1a	普通股權一級(CET1)	1,866,766	1,998,773	2,081,774	1,938,318	1,959,245
2 及 2a	一級	1,866,766	1,998,773	2,081,774	1,938,318	1,959,245
3 及 3a	總資本	1,866,766	1,998,773	2,081,774	1,938,318	1,959,245
	風險加權數額（數額）					
4	風險加權數額總額	2,410,931	2,443,243	2,247,278	2,113,192	2,100,431
4a	風險加權數額總額（下限前）	2,410,931	2,443,243	2,247,278	2,113,192	2,100,431
	風險為本監管資本比率（以風險加權數額的百分率表示）					
5 及 5a	CET1 比率 (%)	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
5b	CET1 比率 (%)（下限前比率）	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
6 及 6a	一級比率 (%)	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
6b	一級比率 (%)（下限前比率）	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
7 及 7a	總資本比率 (%)	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
7b	總資本比率 (%)（下限前比率）	77.4%	81.1%	92.6%	91.6%	93.3%
	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 (%)	0.089%	0.115%	0.071%	0.083%	0.173%
10	較高吸收虧損能力要求 (%)（只適用於 G-SIB 或 D-SIB）	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
11	認可機構特定的總 CET1 緩衝要求 (%)	2.589%	2.615%	2.571%	2.583%	2.673%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的 CET1 (%)	69.4%	73.1%	84.6%	83.6%	85.3%
	《巴塞爾協定三》槓桿比率					
13	總槓桿比率風險承擔計量	2,488,919	2,902,395	2,892,296	2,569,781	2,556,910
13a	以證券融資交易(SFT)資產總額平均值為基礎的槓桿比率風險承擔計量	2,495,797	2,907,745	2,889,987	2,569,281	2,560,789
14、14a 及 14b	槓桿比率 (%)	75.0%	68.3%	72.0%	75.3%	76.6%
14c 及 14d	以 SFT 資產總額平均值為基礎的槓桿比率 (%)	74.8%	68.2%	72.0%	75.4%	76.5%
	流動性覆蓋比率(LCR) / 流動性維持比率(LMR)					
	只適用於第 1 類機構：					
15	優質流動資產(HQLA)總額	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
16	淨現金流出總額	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
17	LCR (%)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
	只適用於第 2 類機構：					
17a	LMR (%)	316.0%	261.9%	234.8%	215.9%	276.4%

J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED (未經審核)

1 主要審慎比率 (續)

		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日	2026 年 3 月 31 日	2025 年 12 月 31 日	2025 年 9 月 30 日
	穩定資金淨額比率(NSFR) / 核心資金比率(CFR)					
	只適用於第 1 類機構：					
18	可用穩定資金總額	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
19	所需穩定資金總額	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
20	NSFR (%)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A
	只適用於第 2A 類機構：					
20a	CFR (%)	N/A	N/A	N/A	N/A	N/A

對比 2026 年 6 月 30 日，LMR 上升是由於本季度流動資產增加所導致。

2 風險加權數額概覽

風險加權數額概覽遵循銀行業(披露)規則第 16C 條有關要求披露（除另有註明外，以千美元列述）。

		風險加權數額		最低資本規定
		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日	2026 年 9 月 30 日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	455,458	520,994	36,437
2	其中 STC 計算法	455,458	520,994	36,437
2a	其中 BSC 計算法	—	—	—
3	其中基礎 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	—	—	—
5a	其中零售 IRB 計算法	—	—	—
5b	其中特定風險權重計算法	—	—	—
5c	其中根據《資本規則》第 376 條及第 12 部第 5、6 及 8 分部計算的對信用風險的加密資產風險承擔	—	—	—
6	對手方信用風險及違責基金承擔	6,911	6,685	553
7	其中 SA-CCR 計算法	70	120	6
7a	其中現行風險承擔方法	—	—	—
8	其中 IMM(CCR)計算法	—	—	—
8a	其中適用於第 2b 組加密資產衍生工具合約的方法	—	—	—
9	其中其他	6,841	6,565	547
10	CVA 風險	70	120	6
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	N/A	N/A	N/A
12	集體投資計劃（CIS）風險承擔—透視計算法／第三方計算法	—	—	—
13	CIS 風險承擔—授權基準計算法	—	—	—
14	CIS 風險承擔—備選方法	—	—	—
14a	CIS 風險承擔—混合使用計算法	—	—	—
15	交收風險	—	—	—

2 風險加權數額概覽 (續)

		風險加權數額		最低資本規定
		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日	2026 年 9 月 30 日
16	銀行帳內的證券化類別風險承擔	—	—	—
17	其中 SEC-IRBA	—	—	—
18	其中 SEC-ERBA（包括 IAA）	—	—	—
19	其中 SEC-SA	—	—	—
19a	其中 SEC-FBA	—	—	—
20	市場風險	33,689	65,221	2,695
21	其中 STM 計算法	33,689	65,221	2,695
22	其中 IMA	—	—	—
22a	其中 SSTM 計算法	—	—	—
23	在交易帳與銀行帳之間調動風險承擔的資本要求	—	—	—
24	業務操作風險	1,914,803	1,850,223	153,184
24a	官方實體集中風險	—	—	—
25	低於扣減門檻的數額（須計算 250%風險權重）	—	—	—
26	應用出項下限水平	不適用	不適用	
27	下限調整（應用過渡上限前）	不適用	不適用	
28	下限調整（應用過渡上限後）	N/A	N/A	N/A
28a	風險加權數額扣減	—	—	—
28b	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	—	—	—
28c	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	—	—	—
29	**總計**	**2,410,931**	**2,443,243**	**192,875**

N/A：不適用於香港

本公司採用標準計算法計算其信用風險，市場風險和業務操作風險的風險加權數額。因為非集中清算衍生工具的總名義數額在永久性基礎上低於 1 兆港元，CVA 風險的風險加權數額的計算為對手方信用風險承擔的風險加權數額的 100%。

對比 2026 年 6 月 30 日，市場風險的風險加權數額減少是由於本季度外匯風險承擔的市場風險資本要求下降所導致。

3 槓桿比率

會計資產對槓桿比率風險承擔計量的比較摘要遵循銀行業(披露)規則第 16FI 條有關要求披露（除另有註明外，以千美元列述）。

		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日
資產負債表內風險承擔			
1	資產負債表內風險承擔（不包括衍生工具合約或 SFT，但包括相關資產負債表內抵押品）	1,777,183	2,191,466
2	還原根據適用會計準則須從資產負債表資產中扣減的就衍生工具合約提供的抵押品數額	—	—
3	扣減：就衍生工具合約提供的現金變動保證金的應收項目資產的扣減	—	—
4	扣減：就 SFT 收到的並已確認為資產的資產（貨幣除外）作出的調整	—	—
5	扣減：從一級資本扣減的與資產負債表內風險承擔相關的特定準備金及集體準備金	—	—
6	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	(18,470)	(19,324)
7	**資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及 SFT）（第 1 至 6 行的總和）**	**1,758,713**	**2,172,142**
由衍生工具合約產生的風險承擔			
8	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）	13	1
9	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	113	176
10	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	—	—
11	經調整後已出售信用關聯衍生工具合約的有效名義數額	—	—
12	扣減：就已出售信用關聯衍生工具合約的有效名義數額獲准的減少及潛在未來風險承擔的附加額獲准的扣減	—	—
13	**衍生工具合約產生的風險承擔總額（第 8 至 12 行的總和）**	**126**	**177**
由SFT產生的風險承擔			
14	經調整出售會計交易後（在不確認淨額計算下）的 SFT 資產總額	730,080	730,076
15	扣減：SFT 資產總額的現金應付額及現金應收額的可抵銷額	—	—
16	SFT 資產的對手方信用風險承擔	—	—
17	代理交易風險承擔	—	—
18	**由 SFT 產生的風險承擔總額（第 14 至 17 行的總和）**	**730,080**	**730,076**
其他資產負債表外風險承擔			
19	資產負債表外風險承擔名義數額總額	—	—
20	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	—	—
21	扣減：從一級資本扣減的與資產負債表外風險承擔相關的特定準備金及集體準備金	—	—
22	**資產負債表外項目（第 19 至 21 行的總和）**	**—**	**—**
資本及風險承擔總額			
23	**一級資本**	**1,866,766**	**1,998,773**
24	**風險承擔總額（第 7、13、18 及 22 行的總和）**	**2,488,919**	**2,902,395**

3 槓桿比率 (續)

		2026 年 9 月 30 日	2026 年 6 月 30 日
槓桿比率			
25 及 25a	**槓桿比率**	**75.0%**	**68.3%**
26	最低槓桿比率規定	**3%**	**3%**
27	適用槓桿緩衝	不適用	不適用
平均值披露			
28	SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）	736,958	735,426
29	SFT 資產總額季度終結值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）	730,080	730,076
30 及 30a	根據第 28 行填報的 SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）得出的風險承擔總額	2,495,797	2,907,745
31 及 31a	根據第 28 行填報的 SFT 資產總額平均值（該總額是經調整出售會計交易及相關的現金應付額及現金應收額淨額後的數額）得出的槓桿比率	74.8%	68.2%