

J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED

根據《銀行業（披露）規則》編製監管披露

二零一七年三月三十一日

1 資本基礎及資本充足比率

資本比率已根據銀行業（資本）規則計算（除另有註明外，以千美元列述）。

	二零一七年 三月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	
資本基礎			
CET1 資本(附註)	849,628	663,035	(A)
一級資本(附註)	849,628	663,035	(B)
二級資本 (附註)	-	125,000	
總資本 (總資本 = 一級資本 + 二級資本)	849,628	788,035	(C)
風險加權總資產			
	2,158,002	2,097,166	(D)
資本比率			
CET1 資本比率 $[(A)/(D) \times 100\%]$	39.3%	31.6%	
一級資本比率 $[(B)/(D) \times 100\%]$	39.3%	31.6%	
總資本比率 $[(C)/(D) \times 100\%]$	39.3%	37.6%	

附註：

於二零一七年二月二十八日，J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED 提早贖回 125,000,000美元後償貸款票據(二級資本)，並轉換為普通股股本(一級資本)。贖回後公司資本總額不變，惟資本架構只餘下一級資本。

2 槓桿比率

槓桿比率已根據銀行業（資本）規則計算（除另有註明外，以千美元列述）。

	二零一七年 三月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	
槓桿比率計算方法:			
風險承擔總額	1,328,687	1,349,882	(A)
一級資本	849,628	663,035	(B)
槓桿比率 $[(B)/(A)] \times 100\%$	63.8%	49.1%	

3 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
		二零一七年 三月三十一日	二零一六年 十二月三十一日	二零一七年 三月三十一日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	517,318	511,263	41,385
2	其中 STC 計算法	517,316	511,263	41,385
2a	其中 BSC 計算法	-	-	-
3	其中 IRB 計算法	-	-	-
4	對手方信用風險	-	-	-
5	其中 SA-CCR 計算法	-	-	-
5a	其中現行風險承擔方法	-	-	-
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	17,810	12,308	1,425
17	其中 STM 計算法	17,810	12,308	1,425
18	其中 IMM 計算法	-	-	-
19	業務操作風險	1,622,874	1,573,595	129,830
20	其中 BIA 計算法	1,622,874	1,573,595	129,830
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	-	-	-
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	2,158,002	2,097,166	172,640
N/A: 不適用於香港情況				