

Banc of America Securities Asia Limited

季度披露報表

截至二零二二年九月三十日

| 內容 | 頁 |
|-------------|-----|
| 1. 主要審慎比率 | 1-2 |
| 2. 風險加權數額概覽 | 2-3 |
| 3. 槓杆比率 | 3-4 |
| 4. 合規聲明 | 4 |

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

(未經審核)

1. 主要審慎比率：

下表概述了本行的主要審慎比率：

| | | 二零二二年 九月三十日 | 二零二二年 六月三十日 | 二零二二年 三月三十一 日 | 二零二一年 十二月三十 一日 | 二零二一年 九月三十日 |
|-----|---------------------------------------|----------------|----------------|---------------------|----------------------|----------------|
| | 監管資本 (千美元) | | | | | |
| 1 | 普通股權一級 (CET1) | 563,926 | 554,163 | 549,832 | 545,174 | 540,323 |
| 2 | 一級 | 563,926 | 554,163 | 549,832 | 545,174 | 540,323 |
| 3 | 總資本 | 563,926 | 554,163 | 549,832 | 545,174 | 540,323 |
| | 監管資本 (千美元) | | | | | |
| 4 | 風險加權數額總額 | 780,776 | 592,116 | 370,884 | 308,492 | 266,000 |
| | 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 (%) | 72.23 | 93.59 | 148.25 | 176.72 | 203.13 |
| 6 | 一級比率 (%) | 72.23 | 93.59 | 148.25 | 176.72 | 203.13 |
| 7 | 總資本比率 (%) | 72.23 | 93.59 | 148.25 | 176.72 | 203.13 |
| | 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 (%) | 2.50 | 2.50 | 2.50 | 2.50 | 2.50 |
| 9 | 逆周期緩衝資本要求 (%) | - | - | 0.01 | - | - |
| 10 | 較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於 G-SIB 或 D-SIB) | NA | NA | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 11 | 認可機構特定的總 CET1 緩衝要求 (%) | 2.50 | 2.50 | 2.51 | 2.50 | 2.50 |
| 12 | 符合認可機構的最低資本規定後可用的 CET1 (%) | 61.73 | 83.08 | 137.74 | 166.22 | 192.63 |
| | 《巴塞爾協定三》槓桿比率 | | | | | |
| 13 | 總槓桿比率風險承擔計量 | 2,817,311 | 2,437,007 | 1,757,555 | 1,269,427 | 581,690 |
| 14 | 槓桿比率 (LR) (%) | 20.02 | 22.74 | 31.28 | 42.95 | 92.89 |
| | 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 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 16 | 淨現金流出總額 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 17 | LCR (%) | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| | 只適用於第 2 類機構： | | | | | |
| 17a | LMR (%) | 995.51 | 1033.90 | 8,905.74 | 13,671.43 | 14,001.85 |
| | 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 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 19 | 所需穩定資金總額 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| 20 | NSFR (%) | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |
| | 只適用於第 2A 類機構： | | | | | |
| 20a | CFR (%) | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 | 不適用 |

截至 2022 年 9 月 30 日，LMR 為 995.51%，較 2022 年 6 月 30 日減少 38.39%。這主要是由本季度平均合格負債增加所推動的。

截至 2022 年 9 月 30 日，CAR 為 72.23%，較 2022 年 6 月 30 日減少 21.36%。這主要是由於與上一季度相比，市場風險敞口較高。

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

(未經審核)

1. 主要審慎比率（續）：

上述主要監管比率乃根據金管局發出的下列相關規則計算。

- 銀行（資本）規則（“BCR”）
- 槓桿率框架
- 銀行業（流動資金）規則（“BLR”）

2. 風險加權數額概覽

本公司之風險加權數額和最低資本規定細分如下。

| | | 風險加權數額 千美元 | | 最低資本規定 千美元 |
|-----|---|----------------|----------------|----------------|
| | | 二零二二年 九月三十日 | 二零二二年 六月三十日 | 二零二二年 九月三十日 |
| 1 | 非證券化類別風險承擔的信用風險 | 52,042 | 83,650 | 4,163 |
| 2 | 其中 STC 計算法 | 52,042 | 83,650 | 4,163 |
| 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 | - | - | - |
| 6 | 對手方違責風險及違責基金承擔 | 20,133 | 30,879 | 1,611 |
| 7 | 其中 SA-CCR* | 10,601 | 19,312 | 848 |
| 7a | 其中現行風險承擔方法 | - | - | - |
| 8 | 其中 IMM (CCR) 計算法 | - | - | - |
| 9 | 其中其他 | - | - | - |
| 10 | CVA 風險 | 9,532 | 11,567 | 763 |
| 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——LTA* | - | - | - |
| 13 | 集體投資計劃風險承擔——MBA* | - | - | - |
| 14 | 集體投資計劃風險承擔——FBA* | - | - | - |
| 14a | 集體投資計劃風險承擔——混合使用計算法* | - | - | - |
| 15 | 交收風險 | - | - | - |
| 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 | - | - | - |
| 19 | 其中 SEC-SA | - | - | - |
| 19a | 其中 SEC-FBA | - | - | - |
| 20 | 市場風險 | 675,294 | 451,978 | 54,024 |
| 21 | 其中 STM 計算法 | 675,294 | 451,978 | 54,024 |
| 22 | 其中 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）* | - | - | - |
| 24 | 業務操作風險 | 33,307 | 25,609 | 2,665 |
| 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 | 資本下限調整 | - | - | - |

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED

(未經審核)

| | | 風險加權數額 千美元 | | 最低資本規定 千美元 |
|-----|--|----------------|----------------|----------------|
| | | 二零二二年 九月三十日 | 二零二二年 六月三十日 | 二零二二年 九月三十日 |
| 26a | 風險加權數額扣減 | - | - | - |
| 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 | - | - | - |
| 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 | 780,776 | 592,116 | 62,463 |

3. 槓桿比率

| | 項目 | 槓桿比率框架 千美元 二零二二年 九月三十日 | 槓桿比率框架 千美元 二零二二年 六月三十日 |
|-----------------------|--|---------------------------------|---------------------------------|
| 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） | 2,717,951 | 2,345,694 |
| 2 | 扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額 | (263) | (16) |
| 3 | 資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及 SFT） | 2,717,688 | 2,345,678 |
| 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） | - | 2,659 |
| 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 | 99,623 | 88,669 |
| 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衍生工具合約的有效名義數額 | - | - |
| 10 | 扣減：就已出售信用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 | 99,623 | 91,328 |
| 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 | - | - |
| 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 | - | - |
| 15 | 代理交易風險承擔 | - | - |
| 16 | 由 SFT 產生的風險承擔總額 | - | - |
| 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 | 563,926 | 554,163 |
| 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 | 2,817,311 | 2,437,007 |
| 20b | 為特定準備金及集體準備金作出的調整 | - | - |

BANC OF AMERICA SECURITIES ASIA LIMITED**(未經審核)**

| | | | |
|-------------|--------------------------|---------------|---------------|
| 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 | 2,817,311 | 2,437,007 |
| 槓桿比率 | | | |
| 22 | 槓桿比率 | 20.02% | 22.74% |

4. 合規聲明

根據《銀行業（披露）規則》（“BDR”）16(2)(a)及金管局的意見，BASAL 已徵詢金管局的同意，繼續將所需的財務披露資料上載至其最終的母公司網站。

由於 BASAL 目前沒有維護自己的互聯網網站，因此在 BDR 16(FE)(1)(b) 節中披露相關資本監管工具的全部條款及條件是不可行的。正因為如此，BASAL 才尋求金管局的上述同意。

此處包括 BASAL 的最終母公司的網站鏈接，據此可以訪問基本財務披露資訊及所有相關資本監管工具的完整條款及條件。

<https://investor.bankofamerica.com/regulatory-and-other-filings/subsidiary-and-country-disclosures>

此資訊也是最接近所需披露資訊的替代資訊。