

J.P. MORGAN SECURITIES (ASIA PACIFIC) LIMITED

根據《銀行業（披露）規則》編製季度監管披露

2024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)。

		2024 年 9 月 30 日	2024 年 6 月 30 日	2024 年 3 月 31 日	2023 年 12 月 31 日	2023 年 9 月 30 日
監管資本 (數額)						
1	普通股權一級(CET1)	1,826,037	1,971,384	1,906,443	1,865,991	1,844,013
2	一級	1,826,037	1,971,384	1,906,443	1,865,991	1,844,013
3	總資本	1,826,037	1,971,384	1,906,443	1,865,991	1,844,013
風險加權數額 (數額)						
4	風險加權數額總額	2,801,330	2,894,031	2,970,880	3,148,920	3,199,319
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 (%)	65.2%	67.8%	64.2%	59.0%	57.6%
6	一級比率 (%)	65.2%	67.8%	64.2%	59.0%	57.6%
7	總資本比率 (%)	65.2%	67.8%	64.2%	59.0%	57.6%
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 (%)	0.286%	0.115%	0.249%	0.079%	0.329%
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 (%)	2.786%	2.615%	2.749%	2.579%	2.829%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的 CET1 (%)	57.2%	59.8%	56.2%	51.0%	49.6%
《巴塞爾協定三》槓桿比率						
13	總槓桿比率風險承擔計量	2,508,511	2,668,577	2,504,481	2,465,460	2,557,623
14	槓桿比率(LR) (%)	72.8%	73.6%	76.1%	75.3%	72.1%
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 (%)	458.9%	465.2%	342.4%	373.3%	356.6%
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 2024 年 6 月 30 日, 資本比率下降是由於本季度支付的股息以致資本減少所導致。

對比 2024 年 6 月 30 日, 逆周期緩衝資本要求上升是由於本公司於本季度在香港特區的私人機構信用風險承擔的風險加權數額增加所導致。

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
		2024 年 9 月 30 日	2024 年 6 月 30 日	2024 年 9 月 30 日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	807,126	871,937	64,570
2	其中 STC 計算法	807,126	871,937	64,570
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	11,221	11,567	898
7	其中 SA-CCR 計算法	-	-	-
7a	其中現行風險承擔方法	-	-	-
8	其中 IMM(CCR)計算法	-	-	-
9	其中其他	11,221	11,567	898
10	CVA 風險	-	-	-
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	N/A	N/A	N/A
13	集體投資計劃風險承擔—MBA	N/A	N/A	N/A
14	集體投資計劃風險承擔—FBA	N/A	N/A	N/A
14a	集體投資計劃風險承擔—混合使用計算法	N/A	N/A	N/A
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 (包括 IAA)	-	-	-
19	其中 SEC-SA	-	-	-
19a	其中 SEC-FBA	-	-	-
20	市場風險	10,863	10,711	869
21	其中 STM 計算法	10,863	10,711	869
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)	N/A	N/A	N/A

2 風險加權數額概覽 (續)

		風險加權數額		最低資本規定
		2024年 9月30日	2024年 6月30日	2024年 9月30日
24	業務操作風險	1,972,120	1,999,816	157,770
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	-	-	-
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	2,801,330	2,894,031	224,107

N/A：不適用於香港情況

本公司分別採用《銀行業(資本)規則》所載的標準(信用風險)計算法(「STC」)和標準(市場風險)計算法(「STM」)計算其信用風險和市場風險，而基本指標計算法(「BIA」)則用作計算業務操作風險。

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)。

		2024 年 9 月 30 日	2024 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)	1,857,200	2,018,389
2	扣減:斷定一級資本時所扣減的資產數額	(18,782)	(20,116)
3	資產負債表內風險承擔總額 (不包括衍生工具合約及 SFT)	1,838,418	1,998,273
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)	-	-
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	-	-
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	-	-
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	670,093	670,304
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	670,093	670,304
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	1,826,037	1,971,384
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	2,508,511	2,668,577
20b	為特定準備金及集體準備金作出的調整	-	-
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	2,508,511	2,668,577
槓桿比率			
22	槓桿比率	72.8%	73.6%