

產銀亞洲金融有限公司

第三支柱監管披露 (未經審核)  
二零二二年六月三十日

## 目錄

|        |                                                          |     |
|--------|----------------------------------------------------------|-----|
| KM1:   | 主要審慎比率                                                   | 1   |
| OV1:   | 風險加權數額概覽                                                 | 2   |
| CC1:   | 監管資本的組成                                                  | 3-5 |
| CC2:   | 監管資本與資產負債表的對帳                                            | 6   |
| CCA:   | 監管資本票據的主要特點                                              | 7   |
| CCyB1: | 用於逆周期緩衝資本的信用風險承擔的地域分佈                                    | 8   |
| LR1:   | 會計資產對槓桿比率風險承擔計量的比較摘要                                     | 9   |
| LR2:   | 槓桿比率                                                     | 10  |
| CR1:   | 風險承擔的信用質素                                                | 11  |
| CR2:   | 違責貸款及債務證券的改變                                             | 12  |
| CR3:   | 認可減低信用風險措施概覽                                             | 13  |
| CR4:   | 信用風險承擔及認可減低信用風險措施的影響—BSC計算法                              | 14  |
| CR5:   | 按資產類別和按風險權重劃分的信用風險承擔—BSC計算法                              | 15  |
| CCR1:  | 按計算法劃分的對手方違責風險的風險承擔<br>(對中央交易對手方的風險承擔除外) 分析              | 16  |
| CCR2:  | 信用估值調整 (CVA) 資本要求                                        | 17  |
| CCR3:  | 按資產類別和按風險權重劃分的對手方違責風險的風險承擔<br>(對中央交易對手方的風險承擔除外) — BSC計算法 | 18  |
| CCR5:  | 作為對手方違責風險的風險承擔 (包括經中央交易對手方結算的合約或交易者)<br>的抵押品組成           | 19  |
| CCR6:  | 信用相關衍生工具合約                                               | 20  |
| CCR8:  | 對中央交易對手方的風險承擔                                            | 21  |
| MR1:   | 在STM計算法下的市場風險                                            | 22  |

## 產銀亞洲金融有限公司

## 主要審慎比率披露

二零二二年六月三十日

|                                     |                                  | (a)            | (b)             | (c)              | (d)            | (e)            |
|-------------------------------------|----------------------------------|----------------|-----------------|------------------|----------------|----------------|
|                                     |                                  | 二零二二年<br>六月三十日 | 二零二二年<br>三月三十一日 | 二零二一年<br>十二月三十一日 | 二零二一年<br>九月三十日 | 二零二一年<br>六月三十日 |
|                                     |                                  | 美元             | 美元              | 美元               | 美元             | 美元             |
| <b>監管資本 (數額)</b>                    |                                  |                |                 |                  |                |                |
| 1                                   | 普通股權一級(CET1)                     | 480,249,084    | 468,860,323     | 463,510,889      | 455,411,124    | 447,292,060    |
| 2                                   | 一級                               | 480,249,084    | 468,860,323     | 463,510,889      | 455,411,124    | 447,292,060    |
| 3                                   | 總資本                              | 491,774,827    | 480,695,817     | 475,570,800      | 465,561,756    | 457,439,393    |
| <b>風險加權數額 (數額)</b>                  |                                  |                |                 |                  |                |                |
| 4                                   | 風險加權數額總額                         | 2,619,999,016  | 2,584,023,584   | 2,716,325,510    | 2,382,637,345  | 2,321,206,678  |
| <b>風險為本監管資本比率 (以風險加權數額的百分率表示)</b>   |                                  |                |                 |                  |                |                |
| 5                                   | CET1比率 (%)                       | 18.33%         | 18.14%          | 17.06%           | 19.11%         | 19.27%         |
| 6                                   | 一級比率 (%)                         | 18.33%         | 18.14%          | 17.06%           | 19.11%         | 19.27%         |
| 7                                   | 總資本比率 (%)                        | 18.77%         | 18.60%          | 17.51%           | 19.54%         | 19.71%         |
| <b>額外CET1緩衝要求 (以風險加權數額的百分率表示)</b>   |                                  |                |                 |                  |                |                |
| 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 (%)                    | 0.29%          | 0.30%           | 0.32%            | 0.30%          | 0.35%          |
| 10                                  | 較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於G-SIB或D-SIB) | -              | -               | -                | -              | -              |
| 11                                  | 認可機構特定的總CET1緩衝要求 (%)             | 2.79%          | 2.80%           | 2.82%            | 2.80%          | 2.85%          |
| 12                                  | 符合認可機構的最低資本規定後可用的CET1 (%)        | 13.83%         | 13.64%          | 12.56%           | 14.61%         | 14.77%         |
| <b>《巴塞爾協定三》槓桿比率</b>                 |                                  |                |                 |                  |                |                |
| 13                                  | 總槓桿比率風險承擔計量                      | 3,281,844,623  | 3,341,949,866   | 3,534,290,122    | 2,980,037,714  | 2,779,394,918  |
| 14                                  | 槓桿比率(LR) (%)                     | 14.63%         | 14.03%          | 13.11%           | 15.28%         | 16.09%         |
| <b>流動性覆蓋比率(LCR) / 流動性維持比率(LMR)</b>  |                                  |                |                 |                  |                |                |
|                                     | 只適用於第1類機構：                       | 不適用            | 不適用             | 不適用              | 不適用            | 不適用            |
| 15                                  | 優質流動資產(HQLA)總額                   |                |                 |                  |                |                |
| 16                                  | 淨現金流出總額                          |                |                 |                  |                |                |
| 17                                  | LCR (%)                          |                |                 |                  |                |                |
|                                     | 只適用於第2類機構：                       |                |                 |                  |                |                |
| 17a                                 | LMR (%)                          | 80.52%         | 68.28%          | 90.42%           | 87.70%         | 67.23%         |
| <b>穩定資金淨額比率(NSFR) / 核心資金比率(CFR)</b> |                                  |                |                 |                  |                |                |
|                                     | 只適用於第1類機構：                       | 不適用            | 不適用             | 不適用              | 不適用            | 不適用            |
| 18                                  | 可用穩定資金總額                         |                |                 |                  |                |                |
| 19                                  | 所需穩定資金總額                         |                |                 |                  |                |                |
| 20                                  | NSFR (%)                         |                |                 |                  |                |                |
|                                     | 只適用於第2A類機構：                      | 不適用            | 不適用             | 不適用              | 不適用            | 不適用            |
| 20a                                 | CFR (%)                          |                |                 |                  |                |                |

**產銀亞洲金融有限公司**

**風險加權數額概覽披露**

二零二二年六月三十日

|     |                                            | (a)            | (b)             | (c)            |
|-----|--------------------------------------------|----------------|-----------------|----------------|
|     |                                            | 風險加權數額         |                 | 最低資本規定         |
|     |                                            | 二零二二年<br>六月三十日 | 二零二二年<br>三月三十一日 | 二零二二年<br>六月三十日 |
|     |                                            | 美元             | 美元              | 美元             |
| 1   | 非證券化類別風險承擔的信用風險                            | 2,486,283,901  | 2,453,906,608   | 198,902,713    |
| 2   | 其中STC計算法                                   | -              | -               | -              |
| 2a  | 其中BSC計算法                                   | 2,486,283,901  | 2,453,906,608   | 198,902,713    |
| 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                             | 6,333,704      | 5,700,182       | 506,696        |
| 7   | 其中 SA-CCR計算法                               | 6,227,166      | 5,643,387       | 498,173        |
| 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                                      | 11,451,923     | 9,338,205       | 916,154        |
| 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                             | 不適用            | 不適用             | 不適用            |
| 13  | 集體投資計劃風險承擔—MBA                             | 不適用            | 不適用             | 不適用            |
| 14  | 集體投資計劃風險承擔—FBA                             | 不適用            | 不適用             | 不適用            |
| 14a | 集體投資計劃風險承擔—混合使用計算法                         | 不適用            | 不適用             | 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                                       | 20,512,821     | 30,131,410      | 1,641,026      |
| 21  | 其中STM計算法                                   | 20,512,821     | 30,131,410      | 1,641,026      |
| 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<br>(經修訂市場風險框架生效前不適用) | 不適用            | 不適用             | 不適用            |
| 24  | 業務操作風險                                     | 95,416,667     | 84,947,179      | 7,633,333      |
| 24a | 官方實體集中風險                                   | 不適用            | 不適用             | 不適用            |
| 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<br>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<br>累積公平價值收益的部分 | -              | -               | -              |
| 27  | 總計                                         | 2,619,999,016  | 2,584,023,584   | 209,599,922    |

產銀亞洲金融有限公司  
監管資本的組成披露  
二零二二年六月三十日

|                             |                                                         | (a)                  | (b)                        |
|-----------------------------|---------------------------------------------------------|----------------------|----------------------------|
|                             |                                                         | 數額                   | 來源以監管綜合範圍下資產負債表的參考號數/字母為依據 |
|                             |                                                         | 二零二二年<br>六月三十日<br>美元 |                            |
| <b>普通股權一級(CET1)資本：票據及儲備</b> |                                                         |                      |                            |
| 1                           | 直接發行的合資格CET1資本票據加任何相關的股份溢價                              | 240,000,000          | 3                          |
| 2                           | 保留溢利                                                    | 255,194,593          | 4+5+6                      |
| 3                           | 已披露儲備                                                   | (8,576,257)          | 7                          |
| 4                           | 須從CET1資本逐步遞減的直接發行股本（只適用於非合股公司）                          | 不適用                  | 不適用                        |
| 5                           | 由綜合銀行附屬公司發行並由第三方持有的CET1資本票據產生的少數股東權益（可計入綜合集團的CET1資本的數額） | 0                    |                            |
| 6                           | <b>監管扣減之前的CET1資本</b>                                    | 486,618,336          |                            |
| <b>CET1資本：監管扣減</b>          |                                                         |                      |                            |
| 7                           | 估值調整                                                    | 0                    |                            |
| 8                           | 商譽（已扣除相聯的遞延稅項負債）                                        | 0                    |                            |
| 9                           | 其他無形資產（已扣除相聯的遞延稅項負債）                                    | 0                    |                            |
| 10                          | 遞延稅項資產（已扣除相聯的遞延稅項負債）                                    | 0                    |                            |
| 11                          | 現金流對沖儲備                                                 | 0                    |                            |
| 12                          | 在IRB計算法下EL總額超出合資格準備金總額之數                                | 0                    |                            |
| 13                          | 由證券化交易產生的提升信用的純利息份額、出售收益及CET1資本的其他增加數額                  | 0                    |                            |
| 14                          | 按公平價值估值的負債因本身的信用風險變動所產生的損益                              | 0                    |                            |
| 15                          | 界定利益的退休基金淨資產（已扣除相聯的遞延稅項負債）                              | 1,704                | 2                          |
| 16                          | 於機構本身的CET1資本票據的投資（若並未在所報告的資產負債表中從實繳資本中扣除）               | 0                    |                            |
| 17                          | 互相交叉持有的CET1資本票據                                         | 0                    |                            |
| 18                          | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的CET1資本票據的非重大LAC投資（超出10%門檻之數）         | 0                    |                            |
| 19                          | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的CET1資本票據的重大LAC投資（超出10%門檻之數）          | 0                    |                            |
| 20                          | 按揭供款管理權（已扣除相聯的遞延稅項負債）                                   | 不適用                  | 不適用                        |
| 21                          | 由暫時性差異產生的遞延稅項資產（已扣除相聯的遞延稅項負債）                           | 不適用                  | 不適用                        |
| 22                          | 超出15%門檻之數                                               | 不適用                  | 不適用                        |
| 23                          | 其中：於金融業實體的普通股的重大投資                                      | 不適用                  | 不適用                        |
| 24                          | 其中：按揭供款管理權                                              | 不適用                  | 不適用                        |
| 25                          | 其中：由暫時性差異產生的遞延稅項資產                                      | 不適用                  | 不適用                        |
| 26                          | 適用於CET1資本的司法管轄區特定監管調整                                   | 6,367,548            |                            |
| 26a                         | 因土地及建築物（自用及投資用途）進行價值重估而產生的累積公平價值收益                      | 0                    |                            |
| 26b                         | 一般銀行業務風險監管儲備                                            | 6,367,548            | 5                          |
| 26c                         | 金融管理專員給予的通知所指明的證券化類別風險承擔                                | 0                    |                            |
| 26d                         | 因機構持有的土地及建築物低於已折舊的成本價值而產生的累積虧損                          | 0                    |                            |
| 26e                         | 受規管非銀行附屬公司的資本短欠                                         | 0                    |                            |
| 26f                         | 於在屬商業實體的有連繫公司中的資本投資（超出申報機構資本基礎的15%之數）                   | 0                    |                            |
| 27                          | 因沒有充足的AT1資本及二級資本以供扣除而須在CET1資本扣除的監管扣減                    | 0                    |                            |
| 28                          | <b>對CET1資本的監管扣減總額</b>                                   | 6,369,252            |                            |
| 29                          | <b>CET1 資本</b>                                          | 480,249,084          |                            |
| <b>AT1資本：票據</b>             |                                                         |                      |                            |
| 30                          | 合資格AT1資本票據加任何相關股份溢價                                     | 0                    |                            |
| 31                          | 其中：根據適用會計準則列為股本類別                                       | 0                    |                            |
| 32                          | 其中：根據適用會計準則列為負債類別                                       | 0                    |                            |
| 33                          | 須從AT1資本逐步遞減的資本票據                                        | 0                    |                            |
| 34                          | 由綜合銀行附屬公司發行並由第三方持有的AT1資本票據(可計入綜合集團的AT1資本的數額)            | 0                    |                            |
| 35                          | 其中：由附屬公司發行須受逐步遞減安排規限的AT1資本票據                            | 0                    |                            |
| 36                          | <b>監管扣減之前的AT1資本</b>                                     | 0                    |                            |

產銀亞洲金融有限公司  
監管資本的組成披露  
二零二二年六月三十日

|                                    |                                                                                                    | (a)                  | (b)                        |
|------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------------|
|                                    |                                                                                                    | 數額                   | 來源以監管綜合範圍下資產負債表的參考號數/字母為依據 |
|                                    |                                                                                                    | 二零二二年<br>六月三十日<br>美元 |                            |
| <b>AT1 資本：監管扣減</b>                 |                                                                                                    |                      |                            |
| 37                                 | 於機構本身的AT1資本票據的投資                                                                                   | 0                    |                            |
| 38                                 | 互相交叉持有AT1資本票據                                                                                      | 0                    |                            |
| 39                                 | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的AT1資本票據的非重大LAC投資（超出10%門檻之數）                                                     | 0                    |                            |
| 40                                 | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的AT1資本票據的重大LAC投資                                                                 | 0                    |                            |
| 41                                 | 適用於AT1資本的司法管轄區特定監管調整                                                                               | 0                    |                            |
| 42                                 | 因沒有充足的二級資本以供扣除而須在AT1資本扣除的監管扣減                                                                      | 0                    |                            |
| 43                                 | <b>對AT1資本的監管扣減總額</b>                                                                               | 0                    |                            |
| 44                                 | <b>AT1 資本</b>                                                                                      | 0                    |                            |
| 45                                 | <b>一級資本（一級資本 = CET1 資本 + AT1 資本）</b>                                                               | 480,249,084          |                            |
| <b>二級資本：票據及準備金</b>                 |                                                                                                    |                      |                            |
| 46                                 | 合資格二級資本票據加任何相關股份溢價                                                                                 | 0                    |                            |
| 47                                 | 須從二級資本逐步遞減的資本票據                                                                                    | 0                    |                            |
| 48                                 | 由綜合銀行附屬公司發行並由第三方持有的二級資本票據（可計入綜合集團的二級資本的數額）                                                         | 0                    |                            |
| 49                                 | 其中：由附屬公司發行須受逐步遞減安排規限的資本票據                                                                          | 0                    |                            |
| 50                                 | 合資格計入二級資本的集體準備金及一般銀行業務風險監管儲備                                                                       | 11,525,743           | 1+5                        |
| 51                                 | <b>監管扣減之前的二級資本</b>                                                                                 | 11,525,743           |                            |
| <b>二級資本：監管扣減</b>                   |                                                                                                    |                      |                            |
| 52                                 | 於機構本身的二級資本票據的投資                                                                                    | 0                    |                            |
| 53                                 | 互相交叉持有的二級資本票據及非資本LAC負債                                                                             | 0                    |                            |
| 54                                 | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的二級資本票據及非資本LAC負債的非重大LAC投資（超出10%門檻及（如適用）5%門檻之數）                                   | 0                    |                            |
| 54a                                | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體的非資本LAC負債的非重大LAC投資（之前被指定為屬5%門檻類別但及後不再符合門檻條件之數）（只適用於在《資本規則》附表4F第2(1)條下被定義為「第2條機構」者） | 0                    |                            |
| 55                                 | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的二級資本票據的重大LAC投資（已扣除合資格短倉）                                                        | 0                    |                            |
| 55a                                | 於在監管綜合範圍以外的金融業實體非資本LAC負債的重大LAC投資（已扣除合資格短倉）                                                         | 0                    |                            |
| 56                                 | 適用於二級資本的司法管轄區特定監管調整                                                                                | 0                    |                            |
| 56a                                | 加回合資格計入二級資本的因土地及建築物（自用及投資用途）進行價值重估而產生的累積公平價值收益                                                     | 0                    |                            |
| 56b                                | 按照《資本規則》第48(1)(g)條規定而須涵蓋，並在二級資本扣除的監管扣減                                                             | 0                    |                            |
| 57                                 | <b>對二級資本的監管扣減總額</b>                                                                                | 0                    |                            |
| 58                                 | <b>二級資本</b>                                                                                        | 11,525,743           |                            |
| 59                                 | <b>總資本（總資本 = 一級資本 + 二級資本）</b>                                                                      | 491,774,827          |                            |
| 60                                 | <b>風險加權總資產</b>                                                                                     | 2,619,999,016        |                            |
| <b>資本比率（估風險加權資產的百分比）</b>           |                                                                                                    |                      |                            |
| 61                                 | CET1 資本比率                                                                                          | 18.33%               |                            |
| 62                                 | 一級資本比率                                                                                             | 18.33%               |                            |
| 63                                 | 總資本比率                                                                                              | 18.77%               |                            |
| 64                                 | 機構特定緩衝資本要求（防護緩衝資本比率 加逆周期緩衝資本比率 加較高吸收虧損能力比率）                                                        | 2.79%                |                            |
| 65                                 | 其中：防護緩衝資本要求                                                                                        | 2.50%                |                            |
| 66                                 | 其中：銀行特定逆周期緩衝資本比率要求                                                                                 | 0.29%                |                            |
| 67                                 | 其中：較高吸收虧損能力比率要求                                                                                    | 0.00%                |                            |
| 68                                 | 用作符合最低資本規定後可供運用的CET1（估風險加權數額的百分比）                                                                  | 13.83%               |                            |
| <b>司法管轄區最低比率（若與《巴塞爾協定三》最低要求不同）</b> |                                                                                                    |                      |                            |
| 69                                 | 司法管轄區CET1最低比率                                                                                      | 不適用                  | 不適用                        |
| 70                                 | 司法管轄區一級資本最低比率                                                                                      | 不適用                  | 不適用                        |
| 71                                 | 司法管轄區總資本最低比率                                                                                       | 不適用                  | 不適用                        |

產銀亞洲金融有限公司  
監管資本的組成披露  
二零二二年六月三十日

|                                                                       | (a)                  | (b)                        |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------------|
|                                                                       | 數額                   | 來源以監管綜合範圍下資產負債表的參考號數/字母為依據 |
|                                                                       | 二零二二年<br>六月三十日<br>美元 |                            |
| <b>低於扣減門檻的數額(風險加權前)</b>                                               |                      |                            |
| 72 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的CET1資本票據、AT1資本票據及二級資本票據以及非資本LAC負債的非重大LAC投資      | 0                    |                            |
| 73 於在監管綜合範圍以外的金融業實體發行的CET1資本票據的重大LAC投資                                | 0                    |                            |
| 74 按揭放款管理權 (已扣除相聯的遞延稅項負債)                                             | 不適用                  | 不適用                        |
| 75 由暫時性差異產生的遞延稅項資產 (已扣除相聯的遞延稅項負債)                                     | 不適用                  | 不適用                        |
| <b>就計入二級資本的準備金的適用上限</b>                                               |                      |                            |
| 76 合資格計入二級資本的有關BSC 計算法或STC計算法及 SEC-ERBA、SEC-SA 及 SEC-FBA下的準備金 (應用上限前) | 11,525,743           |                            |
| 77 在BSC計算法或STC計算法及 SEC-ERBA、SEC-SA 及 SEC-FBA下可計入二級資本的準備金上限            | 11,525,743           |                            |
| 78 合資格計入二級資本的有關IRB計算法及 SEC-IRBA下的準備金 (應用上限前)                          | 0                    |                            |
| 79 在IRB計算法及 SEC-IRBA下可計入二級資本中的準備金上限                                   | 0                    |                            |
| <b>受逐步遞減安排規限的資本票據 (僅在2018年1月1日至2022年1月1日期間適用)</b>                     |                      |                            |
| 80 受逐步遞減安排規限的CET1資本票據的現行上限                                            | 不適用                  | 不適用                        |
| 81 由於實施上限而不計入CET1的數額 (在計及贖回及到期期限後超出上限之數)                              | 不適用                  | 不適用                        |
| 82 受逐步遞減安排規限的AT1資本票據的現行上限                                             | 0                    |                            |
| 83 由於實施上限而不計入AT1資本的數額 (在計及贖回及到期期限後超出上限之數)                             | 0                    |                            |
| 84 受逐步遞減安排規限的二級資本票據的現行上限                                              | 0                    |                            |
| 85 由於實施上限而不計入二級資本的數額 (在計及贖回及到期期限後超出上限之數)                              | 0                    |                            |

**簡釋：**

CET1：普通股權一級資本

AT1：額外一級資本

**產銀亞洲金融有限公司**  
**監管資本與資產負債表的對帳披露**  
 二零二二年六月三十日

已發佈財務報表中的  
 資產負債表  
 二零二二年  
 六月三十日

參照監管資本的  
 組成

美元

**資產**

|                    |                      |   |
|--------------------|----------------------|---|
| 現金及銀行同業和其他金融機構結餘   | 14,540,056           |   |
| 銀行同業和其他金融機構存款      | 231,644,753          |   |
| 其中：整體準備金反映於規管資本    | 45,498               | 1 |
| 貿易票據               | 146,489,023          |   |
| 其中：整體準備金反映於規管資本    | 30,067               | 1 |
| 按公平價值計入損益之金融資產     | 115,454,693          |   |
| 貸款                 | 2,093,327,668        |   |
| 其中：整體準備金反映於規管資本    | 4,714,929            | 1 |
| 按公平價值計入其他全面收入之金融資產 | 426,850,328          |   |
| 物業及設備              | 855,018              |   |
| 使用權資產              | 4,831,087            |   |
| 應收利息及其他資產          | 38,294,673           |   |
| 其中：整體準備金反映於規管資本    | 45,056               | 1 |
| <b>資產總額</b>        | <b>3,072,287,299</b> |   |

**權益及負債**

**負債**

|                        |                      |   |
|------------------------|----------------------|---|
| 銀行同業及其他金融機構之存款及結餘      | 2,108,208,941        |   |
| 客戶存款                   | 11,069,212           |   |
| 按公平價值計入損益之金融負債         | 2,064,315            |   |
| 已發行存款證                 | 429,393,815          |   |
| 租賃負債                   | 4,822,403            |   |
| 應付稅項                   | 7,737,018            |   |
| 應付利息及其他負債              | 22,154,241           |   |
| 其中：整體準備金反映於規管資本        | 322,645              | 1 |
| 遞延稅項負債                 | 219,018              |   |
| 其中：遞延稅項資產相關於界定利益的退休金基金 | 1,704                | 2 |
| <b>負債總額</b>            | <b>2,585,668,963</b> |   |

**權益屬於本公司擁有人**

|           |             |   |
|-----------|-------------|---|
| 股本        | 240,000,000 | 3 |
| 儲備        | 246,618,336 |   |
| 其中：保留溢利   | 221,917,745 | 4 |
| ：規管儲備     | 6,367,548   | 5 |
| ：本年度溢利    | 26,909,300  | 6 |
| ：累計其他全面收入 | (8,576,257) | 7 |

**權益總額** **486,618,336**

**權益及負債總額** **3,072,287,299**



**產銀亞洲金融有限公司**  
**監管資本票據的主要特點披露**  
**二零二二年六月三十日**

|    |                                                     | (a)                                                                                                                                                                                     |
|----|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                     | 量化資料 / 描述資料                                                                                                                                                                             |
| 1  | 發行人                                                 | 產銀亞洲金融有限公司                                                                                                                                                                              |
| 2  | 獨有識別碼 (如CUSIP、ISIN或Bloomberg對私人配售的識別碼)              | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 3  | 票據的管限法律                                             | 中華人民共和國香港特別行政區                                                                                                                                                                          |
|    | 監管處理方法                                              |                                                                                                                                                                                         |
| 4  | 保留溢利                                                | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 5  | 《巴塞爾協定三》後過渡期規則 <sup>2</sup>                         | CET1資本                                                                                                                                                                                  |
| 6  | 可計入單獨 / 集團 / 單獨及集團基礎                                | 單獨                                                                                                                                                                                      |
| 7  | 票據類別 (由各地區自行指明)                                     | 普通股                                                                                                                                                                                     |
| 8  | 在監管資本的確認數額 (以有關貨幣百萬計, 於最近的報告日期)                     | 240百萬美元                                                                                                                                                                                 |
| 9  | 票據面值                                                | 每股1美元                                                                                                                                                                                   |
| 10 | 會計分類                                                | 股東權益                                                                                                                                                                                    |
| 11 | 最初發行日期                                              | 二零一九年七月三十一日 (100百萬美元)<br>二零零七年二月二十三日 (50百萬美元)<br>二零零五年三月十八日 (20百萬美元)<br>二零零二年七月二十四日 (10百萬美元)<br>一九九九年九月二十日 (25百萬美元)<br>一九九五年三月二十九日 (20百萬美元)<br>一九九零年三月五日 (5百萬美元)<br>一九八六年一月二十日 (10百萬美元) |
| 12 | 永久性或設定期限                                            | 永久性                                                                                                                                                                                     |
| 13 | 原訂到期日                                               | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 14 | 須獲監管當局事先批准的發行人贖回權                                   | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 15 | 可選擇可贖回日、或有可贖回日, 以及可贖回數額                             | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 16 | 後續可贖回日(如適用)                                         | 不適用                                                                                                                                                                                     |
|    | 票息 / 股息                                             |                                                                                                                                                                                         |
| 17 | 固定或浮動股息 / 票息                                        | 浮動                                                                                                                                                                                      |
| 18 | 票息率及任何相關指數                                          | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 19 | 有停止派發股息的機制                                          | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 20 | 全部酌情、部分酌情, 或強制                                      | 全部酌情                                                                                                                                                                                    |
| 21 | 設有遞升息率或其他贖回誘因                                       | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 22 | 非累計或累計                                              | 非累計                                                                                                                                                                                     |
| 23 | 可轉換或不可轉換                                            | 不可轉換                                                                                                                                                                                    |
| 24 | 若可轉換, 轉換觸發事件                                        | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 25 | 若可轉換, 全部或部分                                         | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 26 | 若可轉換, 轉換比率                                          | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 27 | 若可轉換, 強制或可選擇性轉換                                     | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 28 | 若可轉換, 指明轉換後的票據類別                                    | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 29 | 若可轉換, 指明轉換後的票據發行人                                   | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 30 | 減值特點                                                | 沒有                                                                                                                                                                                      |
| 31 | 若減值, 減值的觸發點                                         | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 32 | 若減值, 全部或部分                                          | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 33 | 若減值, 永久或臨時性質                                        | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 34 | 若屬臨時減值, 說明債務回復機制                                    | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 35 | 清盤時在償還優次級別中的位置 (指明相關法律實體無力償債時在償權人等級中緊接較其優先的票據的票據類別) | 不適用                                                                                                                                                                                     |
| 36 | 可過渡的不合規特點                                           | 沒有                                                                                                                                                                                      |
| 37 | 若是, 指明不合規特點                                         | 不適用                                                                                                                                                                                     |

註：

<sup>1</sup> 須遵守《銀行業(資本)規則》附表4H所載的過渡安排下的資本票據的監管處理方法。

<sup>2</sup> 無須遵守《銀行業(資本)規則》附表4H所載的過渡安排下的資本票據的監管處理方法。

**產銀亞洲金融有限公司****用於逆週期緩衝資本(CCyB)的信用風險承擔的地域分布披露****二零二二年六月三十日**

逆週期緩衝資本比率乃按照香港金融管理局發出之《銀行業(資本)規則》計算。本公司的具體逆週期緩衝資本率是以適用的司法管轄區（指本公司擁有私營企業信貸風險的地區(包括香港)）之逆週期緩衝資本率的加權平均數值計算。歸屬於一個特定司法管轄區的適用逆週期緩衝資本率之加權是本公司在該司法管轄區(風險的所在地盡可能以最終的風險的基礎上確定)擁有私營企業信貸風險(銀行賬戶和交易賬戶)的總風險加權金額與本公司在其中擁有私營企業信貸風險的所有司法管轄區的總風險加權金額的總和之比率。如擔保人與交易方位於不同國家，信貸風險將被轉移到擔保人的國家。

與私營企業信貸風險有關之風險加權金額，按地理區域劃分列示如下：

| 按司法管轄區(J)列出的地域分布 | 當時生效的適用JCCyB比率 | 用作計算逆週期緩衝資本比率的風險加權數額<br>美元 | 認可機構特定逆週期緩衝資本比率 | 逆週期緩衝資本數額<br>美元  |
|------------------|----------------|----------------------------|-----------------|------------------|
| 香港               | 1.000%         | 632,184,145                |                 |                  |
| 中國               | -              | 906,333,382                |                 |                  |
| 盧森堡              | 0.500%         | 34,421,507                 |                 |                  |
| <b>總和</b>        |                | <b>1,572,939,034</b>       |                 |                  |
| <b>總計</b>        |                | <b>2,244,689,450</b>       | <b>0.289%</b>   | <b>6,487,153</b> |

**產銀亞洲金融有限公司**  
**會計資產對槓桿比率風險承擔計量的比較摘要披露**  
**二零二二年六月三十日**

|    | 項目                                                      | 在槓桿比率框架下的值<br>美元     |
|----|---------------------------------------------------------|----------------------|
| 1  | 已發布的財務報表所載的綜合資產總額                                       | 3,072,287,299        |
| 2  | 對為會計目的須作綜合計算，但在監管綜合範圍以外的銀行、金融、保險或商業實體的投資而須作的相關調整        | -                    |
| 2a | 有關符合操作規定可作認可風險轉移的證券化風險承擔的調整                             | -                    |
| 3  | 根據認可機構的適用會計框架於資產負債表內確認，但不包括在槓桿比率風險承擔計量值內的任何受信資產而須作的相關調整 | -                    |
| 3a | 有關合資格的現金池交易的調整                                          | -                    |
| 4  | 有關衍生工具合約的調整                                             | 16,456,067           |
| 5  | 有關證券融資交易的調整（即回購交易及其他類似的有抵押借貸）                           | -                    |
| 6  | 有關資產負債表外項目的調整（即資產負債表外風險承擔轉換為信貸等值數額）                     | 185,048,707          |
| 6a | 可從風險承擔計量豁除的審慎估值調整及集體準備金及特定準備金的調整                        | (322,645)            |
| 7  | 其他調整                                                    | 8,375,195            |
| 8  | <b>槓桿比率風險承擔計量</b>                                       | <b>3,281,844,623</b> |

## 產銀亞洲金融有限公司

## 槓桿比率披露

二零二二年六月三十日

|                       |                                                  | (a)                  | (b)                  |
|-----------------------|--------------------------------------------------|----------------------|----------------------|
|                       |                                                  | 美元                   |                      |
|                       |                                                  | 於二零二二年<br>六月三十日      | 於二零二二年<br>三月三十一日     |
| <b>資產負債表內風險承擔</b>     |                                                  |                      |                      |
| 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） | 3,060,290,232        | 3,136,202,630        |
| 2                     | 扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額                               | (1,704)              | -                    |
| 3                     | <b>資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及SFT）</b>               | <b>3,060,288,528</b> | <b>3,136,202,630</b> |
| <b>由衍生工具合約產生的風險承擔</b> |                                                  |                      |                      |
| 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）    | 20,373,966           | 11,265,072           |
| 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                        | 16,456,067           | 21,061,053           |
| 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                    | <b>衍生工具合約產生的風險承擔總額</b>                           | <b>36,830,033</b>    | <b>32,326,125</b>    |
| <b>由SFT產生的風險承擔</b>    |                                                  |                      |                      |
| 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                    | <b>由SFT產生的風險承擔總額</b>                             | <b>-</b>             | <b>-</b>             |
| <b>其他資產負債表外風險承擔</b>   |                                                  |                      |                      |
| 17                    | 資產負債表外風險承擔名義數額總額                                 | 444,899,255          | 405,844,494          |
| 18                    | 扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整                               | (259,850,548)        | (232,139,471)        |
| 19                    | <b>資產負債表外項目</b>                                  | <b>185,048,707</b>   | <b>173,705,023</b>   |
| <b>資本及風險承擔總額</b>      |                                                  |                      |                      |
| 20                    | <b>一級資本</b>                                      | <b>480,249,084</b>   | <b>468,860,323</b>   |
| 20a                   | <b>為特定準備金及集體準備金作出調整前的風險承擔總額</b>                  | <b>3,282,167,268</b> | <b>3,342,233,778</b> |
| 20b                   | <b>為特定準備金及集體準備金作出的調整</b>                         | <b>(322,645)</b>     | <b>(283,912)</b>     |
| 21                    | <b>為特定準備金及集體準備金作出調整後的風險承擔總額</b>                  | <b>3,281,844,623</b> | <b>3,341,949,866</b> |
| <b>槓桿比率</b>           |                                                  |                      |                      |
| 22                    | <b>槓桿比率</b>                                      | <b>14.63%</b>        | <b>14.03%</b>        |

產銀亞洲金融有限公司  
風險承擔的信用質素披露  
二零二二年六月三十日

|   |            | (a)           | (b)            | (c)        | (d)                                  | (e)                   | (f)                                  | (g)           |
|---|------------|---------------|----------------|------------|--------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------|---------------|
|   |            | 以下項目的總帳面數額    |                | 備抵/減值      | 其中：為STC計算法下的風險承擔的信用損失而作出的預期信用損失會計準備金 |                       | 其中：為IRB計算法下的風險承擔的信用損失而作出的預期信用損失會計準備金 | 淨值<br>(a+b-c) |
|   |            | 違責風險的<br>風險承擔 | 非違責風險的<br>風險承擔 |            | 分配於<br>監管類別的特定準<br>備金                | 分配於<br>監管類別的集體準<br>備金 |                                      |               |
|   |            | 美元            | 美元             |            | 美元                                   | 美元                    | 美元                                   | 美元            |
| 1 | 貸款         | 9,760,000     | 2,098,042,597  | 14,474,929 | -                                    | -                     | -                                    | 2,093,327,668 |
| 2 | 債務證券       | -             | 426,796,881    | 248,861    | -                                    | -                     | -                                    | 426,548,020   |
| 3 | 資產負債表外風險承擔 | -             | 332,049,963    | 319,630    | -                                    | -                     | -                                    | 331,730,333   |
| 4 | 總計         | 9,760,000     | 2,856,889,441  | 15,043,420 | -                                    | -                     | -                                    | 2,851,606,021 |

產銀亞洲金融有限公司  
違責貸款及債務證券的改變披露  
二零二二年六月三十日

|   |                     | (a)       |
|---|---------------------|-----------|
|   |                     | 美元        |
| 1 | 於上一個報告期末違責貸款及債務證券結餘 | 9,760,000 |
| 2 | 期內發生的違責貸款及債務證券      | -         |
| 3 | 轉回至非違責狀況            | -         |
| 4 | 撇帳額                 | -         |
| 5 | 其他變動                | -         |
| 6 | 於現行報告期末違責貸款及債務證券結餘  | 9,760,000 |

產銀亞洲金融有限公司  
認可減低信用風險措施概覽披露  
二零二二年六月三十日

|   |        | (a)                  | (b1)               | (b)            | (d)                | (f)                 |
|---|--------|----------------------|--------------------|----------------|--------------------|---------------------|
|   |        | 無保證風險承擔：帳面數額         | 有保證風險承擔            | 以認可抵押品作保證的風險承擔 | 以認可擔保作保證的風險承擔      | 以認可信用衍生工具合約作保證的風險承擔 |
|   |        | 美元                   | 美元                 | 美元             | 美元                 | 美元                  |
| 1 | 貸款     | 1,968,829,322        | 124,498,346        | -              | 124,498,346        | -                   |
| 2 | 債務證券   | 411,519,296          | 15,028,724         | -              | 15,028,724         | -                   |
| 3 | 總計     | <b>2,380,348,618</b> | <b>139,527,070</b> | -              | <b>139,527,070</b> | -                   |
| 4 | 其中違責部分 | 9,760,000            | -                  | -              | -                  | -                   |

## 產銀亞洲金融有限公司

## 信用風險承擔及認可減低信用風險措施的影響披露 - BSC計算法

二零二二年六月三十日

|        |                                  | (a)                     | (b)         | (c)                     | (d)         | (e)                 | (f)      |
|--------|----------------------------------|-------------------------|-------------|-------------------------|-------------|---------------------|----------|
|        |                                  | 未將CCF及減低信用風險措施計算在內的風險承擔 |             | 已將CCF及減低信用風險措施計算在內的風險承擔 |             | 風險加權數額及<br>風險加權數額密度 |          |
|        |                                  | 資產負債表內數額                | 資產負債表外數額    | 資產負債表內數額                | 資產負債表外數額    | 風險加權數額              | 風險加權數額密度 |
| 風險承擔類別 |                                  | 美元                      | 美元          | 美元                      | 美元          | 美元                  | 百份比      |
| 1      | 官方實體風險承擔                         | 63,259,626              | -           | 63,259,626              | -           | 12,651,925          | 20%      |
| 2      | 公營單位風險承擔                         | 99,230,994              | -           | 99,230,994              | -           | 19,846,199          | 20%      |
| 3      | 多邊發展銀行風險承擔                       | -                       | -           | -                       | -           | -                   | 0%       |
| 4      | 銀行風險承擔                           | 945,280,368             | -           | 820,379,312             | -           | 180,598,461         | 22%      |
| 5      | 現金項目                             | 623                     | -           | 623                     | -           | -                   | 0%       |
| 6      | 以貨銀對付形式以外的形式進行的交易<br>交付失敗所涉的風險承擔 | -                       | -           | -                       | -           | -                   | 0%       |
| 7      | 住宅按揭貸款                           | -                       | -           | -                       | -           | -                   | 0%       |
| 8      | 其他風險承擔                           | 1,963,237,552           | 444,899,255 | 2,088,138,609           | 185,048,706 | 2,273,187,316       | 100%     |
| 9      | 對商業實體的重大風險承擔                     | -                       | -           | -                       | -           | -                   | 0%       |
| 10     | 總計                               | 3,071,009,163           | 444,899,255 | 3,071,009,164           | 185,048,706 | 2,486,283,901       | 76%      |



## 產銀亞洲金融有限公司

## 按資產類別和按風險權重劃分的信用風險承擔披露 - BSC計算法

二零二二年六月三十日

| <div>風險權重</div> <div>風險承擔類別</div> |                              | (a) | (b) | (c)         | (d) | (e)         | (f)           | (g)  | (h) | (i)                          |
|-----------------------------------|------------------------------|-----|-----|-------------|-----|-------------|---------------|------|-----|------------------------------|
|                                   |                              | 0%  | 10% | 20%         | 35% | 50%         | 100%          | 250% | 其他  | 總信用風險承擔額（已將CCF及減低信用風險措施計算在內） |
|                                   |                              | 美元  | 美元  | 美元          | 美元  | 美元          | 美元            | 美元   | 美元  | 美元                           |
| 1                                 | 官方實體風險承擔                     | -   | -   | 63,259,626  | -   | -           | -             | -    | -   | 63,259,626                   |
| 2                                 | 公營單位風險承擔                     | -   | -   | 99,230,994  | -   | -           | -             | -    | -   | 99,230,994                   |
| 3                                 | 多邊發展銀行風險承擔                   | -   | -   | -           | -   | -           | -             | -    | -   | -                            |
| 4                                 | 銀行風險承擔                       | -   | -   | 799,726,064 | -   | -           | 20,653,248    | -    | -   | 820,379,312                  |
| 5                                 | 現金項目                         | 623 | -   | -           | -   | -           | -             | -    | -   | 623                          |
| 6                                 | 以貨銀對付形式以外的形式進行的交易交付失敗所涉的風險承擔 | -   | -   | -           | -   | -           | -             | -    | -   | -                            |
| 7                                 | 住宅按揭貸款                       | -   | -   | -           | -   | -           | -             | -    | -   | -                            |
| 8                                 | 其他風險承擔                       | -   | -   | 24,933,946  | -   | 160,114,760 | 2,088,138,609 | -    | -   | 2,273,187,315                |
| 9                                 | 對商業實體的重大風險承擔                 | -   | -   | -           | -   | -           | -             | -    | -   | -                            |
| 10                                | 總計                           | 623 | -   | 987,150,630 | -   | 160,114,760 | 2,108,791,857 | -    | -   | 3,256,057,870                |

## 產銀亞洲金融有限公司

## 按計算法劃分的對手方違責風險的風險承擔（對中央交易對手方的風險承擔除外）分析披露

二零二二年六月三十日

|    |                     | (a)        | (b)          | (c)           | (d)                 | (e)                                  | (f)       |
|----|---------------------|------------|--------------|---------------|---------------------|--------------------------------------|-----------|
|    |                     | 重置成本       | 潛在未來<br>風險承擔 | 有效預期正<br>風險承擔 | 用作計算違責風險<br>的風險承擔的α | 已將減低信用風險<br>措施計算在內的違<br>責風險的<br>風險承擔 | 風險加權數額    |
|    |                     | 美元         | 美元           | 美元            |                     | 美元                                   | 美元        |
| 1  | SA-CCR計算法（對於衍生工具合約） | 11,997,068 | 9,531,552    |               | 1.4                 | 30,140,067                           | 6,227,166 |
| 1a | 現行風險承擔方法（對於衍生工具合約）  | -          | -            |               | 1.4                 | -                                    | -         |
| 2  | IMM(CCR)計算法         |            |              | -             | -                   | -                                    | -         |
| 3  | 簡易方法（對於證券融資交易）      |            |              |               |                     | -                                    | -         |
| 4  | 全面方法（對於證券融資交易）      |            |              |               |                     | -                                    | -         |
| 5  | 風險值（對於證券融資交易）       |            |              |               |                     | -                                    | -         |
| 6  | 總計                  |            |              |               |                     |                                      | 6,227,166 |

產銀亞洲金融有限公司  
信用估值調整 (CVA) 資本要求披露  
二零二二年六月三十日

|   |                             | (a)                          | (b)               |
|---|-----------------------------|------------------------------|-------------------|
|   |                             | 已將減低信用風險<br>措施效果計算在內的<br>EAD | 風險加權數額            |
|   |                             | 美元                           | 美元                |
|   | 使用高級CVA方法計算CVA資本要求的淨額計算組合   | -                            | -                 |
| 1 | (i) 風險值 (使用倍增因數 (如適用) 後)    |                              | -                 |
| 2 | (ii) 受壓風險值 (使用倍增因數 (如適用) 後) |                              | -                 |
| 3 | 使用標準CVA方法計算CVA資本要求的淨額計算組合   | 35,468,914                   | 11,451,923        |
| 4 | <b>總計</b>                   | <b>35,468,914</b>            | <b>11,451,923</b> |

產銀亞洲金融有限公司

按資產類別和按風險權重劃分的對手方違責風險的風險承擔（對中央交易對手方的風險承擔除外）披露 - BSC計算法

二零二二年六月三十日

|        |              | (a) | (b) | (c)        | (ca) | (d) | (f)     | (ga) | (h) | (i)                               |
|--------|--------------|-----|-----|------------|------|-----|---------|------|-----|-----------------------------------|
| 風險權重   |              | 0%  | 10% | 20%        | 35%  | 50% | 100%    | 250% | 其他  | 已將減低信用風險措施<br>計算在內的總違責風險<br>的風險承擔 |
| 風險承擔類別 |              | 美元  | 美元  | 美元         | 美元   | 美元  | 美元      | 美元   | 美元  | 美元                                |
| 1      | 官方實體風險承擔     | -   | -   | -          | -    | -   | -       | -    | -   | -                                 |
| 2      | 公營單位風險承擔     | -   | -   | -          | -    | -   | -       | -    | -   | -                                 |
| 3      | 多邊發展銀行風險承擔   | -   | -   | -          | -    | -   | -       | -    | -   | -                                 |
| 4      | 銀行風險承擔       | -   | -   | 29,891,127 | -    | -   | -       | -    | -   | 29,891,127                        |
| 5      | 集體投資計劃風險承擔   | -   | -   | -          | -    | -   | -       | -    | -   | -                                 |
| 6      | 其他風險承擔       | -   | -   | -          | -    | -   | 248,940 | -    | -   | 248,940                           |
| 7      | 對商業實體的重大風險承擔 | -   | -   | -          | -    | -   | -       | -    | -   | -                                 |
| 8      | 總計           | -   | -   | 29,891,127 | -    | -   | 248,940 | -    | -   | 30,140,067                        |

產銀亞洲金融有限公司

作為對手方違責風險的風險承擔（包括經中央交易對手方結算的合約或交易者）的抵押品組成披露

二零二二年六月三十日

|           | (a)               | (b)  | (c)             | (d)  | (e)               | (f)             |
|-----------|-------------------|------|-----------------|------|-------------------|-----------------|
|           | 衍生工具合約            |      |                 |      | 證券融資交易            |                 |
|           | 收取的認可抵押品的<br>公平價值 |      | 提供的抵押品的<br>公平價值 |      | 收取的認可抵押品<br>的公平價值 | 提供的抵押品的公<br>平價值 |
|           | 分隔的               | 非分隔的 | 分隔的             | 非分隔的 |                   |                 |
|           | 美元                | 美元   | 美元              | 美元   | 美元                | 美元              |
| 現金 - 本地貨幣 | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 現金 - 其他貨幣 | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 本地國債      | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 其他國債      | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 政府機構債券    | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 銀行債券      | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 法團債券      | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 股權證券      | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 其他抵押品     | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |
| 總計        | -                 | -    | -               | -    | -                 | -               |

本期間並沒有衍生工具合約或證券融資交易所提供的抵押品，或所收取的認可抵押品。

產銀亞洲金融有限公司  
信用相關衍生工具合約披露  
二零二二年六月三十日

|              | (a)   | (b)   |
|--------------|-------|-------|
|              | 購買的保障 | 出售的保障 |
|              | 美元    | 美元    |
| <b>名義數額</b>  |       |       |
| 單一名稱信用違責掉期   | -     | -     |
| 指數信用違責掉期     | -     | -     |
| 總回報掉期        | -     | -     |
| 信用相關期權       | -     | -     |
| 其他信用相關衍生工具合約 | -     | -     |
| <b>總名義數額</b> | -     | -     |
| <b>公平價值</b>  |       |       |
| 正公平價值（資產）    | -     | -     |
| 負公平價值（負債）    | -     | -     |

本期間並沒有信用相關衍生工具合約。

產銀亞洲金融有限公司  
對中央交易對手方的風險承擔披露  
二零二二年六月三十日

|    |                                              | (a)                         | (b)     |
|----|----------------------------------------------|-----------------------------|---------|
|    |                                              | 已將減低信用風險<br>措施計算在內的風<br>險承擔 | 風險加權數額  |
|    |                                              | 美元                          | 美元      |
| 1  | 認可機構作為結算成員或結算客戶對合資格中央交易對手方的風險承擔（總額）          |                             | 106,538 |
| 2  | 對合資格中央交易對手方的違責風險的風險承擔（不包括於第7至10行披露的項目），其中：   | 5,328,847                   | 106,538 |
| 3  | (i) 場外衍生工具交易                                 | 5,328,847                   | 106,538 |
| 4  | (ii) 交易所買賣衍生工具合約                             | -                           | -       |
| 5  | (iii) 證券融資交易                                 | -                           | -       |
| 6  | (iv) 受有效跨產品淨額結算協議規限的淨額計算組合                   | -                           | -       |
| 7  | 分隔的開倉保證金                                     | -                           |         |
| 8  | 非分隔的開倉保證金                                    | -                           | -       |
| 9  | 以資金支持的違責基金承擔                                 | -                           | -       |
| 10 | 非以資金支持的違責基金承擔                                | -                           | -       |
| 11 | 認可機構作為結算成員或結算客戶對不合資格中央交易對手方的風險承擔（總額）         |                             | -       |
| 12 | 對不合資格中央交易對手方的違責風險的風險承擔（不包括於第17至20行披露的項目），其中： | -                           | -       |
| 13 | (i) 場外衍生工具交易                                 | -                           | -       |
| 14 | (ii) 交易所買賣衍生工具合約                             | -                           | -       |
| 15 | (iii) 證券融資交易                                 | -                           | -       |
| 16 | (iv) 受有效跨產品淨額結算協議規限的淨額計算組合                   | -                           | -       |
| 17 | 分隔的開倉保證金                                     | -                           |         |
| 18 | 非分隔的開倉保證金                                    | -                           | -       |
| 19 | 以資金支持的違責基金承擔                                 | -                           | -       |
| 20 | 非以資金支持的違責基金承擔                                | -                           | -       |

產銀亞洲金融有限公司  
在STM計算法下的市場風險披露  
二零二二年六月三十日

|   |                 | (a)        |
|---|-----------------|------------|
|   |                 | 風險加權數額     |
|   |                 | 美元         |
|   | 直接產品風險承擔        |            |
| 1 | 利率風險承擔（一般及特定風險） | 18,129,808 |
| 2 | 股權風險承擔（一般及特定風險） | -          |
| 3 | 外匯（包括黃金）風險承擔    | 2,383,013  |
| 4 | 商品風險承擔          | -          |
|   | 期權風險承擔          |            |
| 5 | 簡化計算法           | -          |
| 6 | 得爾塔附加計算法        | -          |
| 7 | 其他計算法           | -          |
| 8 | 證券化類別風險承擔       | -          |
| 9 | 總計              | 20,512,821 |