



WOORI GLOBAL MARKETS ASIA LIMITED
友利投資金融有限公司

監管披露

截至二零一九年六月三十日止季度

友利投資金融有限公司

監管披露

目錄

	頁次
1. KM1：主要審慎比率	1
2. OV1：風險加權數額概覽	2
3. LR2：槓桿比率	3
4. LIQ1：流動性覆蓋比率——第1類機構	4
5. CR8：在IRB計算法下信用風險承擔的風險加權數額流動表	4
6. CCR7：在IMM(CCR)計算法下違責風險的風險承擔的風險加權數額流動表	4
7. MR2：在IMM計算法下市場風險承擔的風險加權數額流動表	4

KM1：主要審慎比率

	(a)	(b)	(c)	(d)	(e)
	於二零一九年 六月三十日	於二零一九年 三月三十一日	於二零一八年 十二月三十一日	於二零一八年 九月三十日	於二零一八年 六月三十日
監管資本 (美元)					
1 普通股權一級(CET1)	112,101,207	108,869,952	106,803,687	105,949,239	104,865,584
2 一級	112,101,207	108,869,952	106,803,687	105,949,239	104,865,584
3 總資本	114,638,926	111,207,960	109,000,039	107,898,275	106,619,867
風險加權數額 (美元)					
4 風險加權數額總額	480,390,410	455,770,765	416,462,978	347,788,478	304,166,742
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 (%)	23.34%	23.89%	25.65%	30.46%	34.48%
6 一級比率 (%)	23.34%	23.89%	25.65%	30.46%	34.48%
7 總資本比率 (%)	23.86%	24.40%	26.17%	31.02%	35.05%
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%	1.875%	1.875%	1.875%
9 逆周期緩衝資本要求 (%)	0.612%	0.636%	0.499%	0.548%	0.601%
10 較高吸收虧損能力要求 (%) (只適用於G-SIB或D-SIB)	0%	0%	0%	0%	0%
11 認可機構特定的總CET1緩衝要求 (%)	3.112%	3.136%	2.374%	2.423%	2.476%
12 符合認可機構的最低資本規定後可用的CET1 (%)	15.86%	16.40%	18.17%	23.02%	27.05%
《巴塞爾協定三》槓桿比率					
13 總槓桿比率風險承擔計量	563,267,454	516,529,359	477,579,237	419,265,134	376,720,156
14 槓桿比率(LR) (%)	19.90%	21.08%	22.36%	25.27%	27.84%
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 (%)	119.17%	136.30%	125.99%	110.06%	155.88%
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

由於本行之客戶貸款和投資債務證券承擔數額增加以及引入了私募基金投資此新業務，本行於報告期內之風險加權數額總額亦相應增加並導致總資本比率下降。雖然債務證券投資的增加令流動資產上升，但由於貸款承諾以及私募基金投資承諾的增加所引起的合資格負債抵消了前述之流動資產升幅。因此，本行之流動性維持比率在報告期內出現下降趨勢。

OV1：風險加權數額概覽

美元		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
		於二零一九年 六月三十日	於二零一九年 三月三十一日	於二零一九年 六月三十日
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	458,583,537	436,117,015	36,686,683
2	其中STC計算法	-	-	-
2a	其中BSC計算法	458,583,537	436,117,015	36,686,683
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	6,028,841	6,030,515	482,307
7	其中SA-CCR*	不適用	不適用	不適用
7a	其中現行風險承擔方法	-	-	-
8	其中IMM(CCR)計算法	-	-	-
9	其中其他	6,028,841	6,030,515	482,307
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*	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	-	-	-
21	其中STM計算法	-	-	-
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）*	不適用	不適用	不適用
24	業務操作風險	15,778,032	13,623,234	1,262,243
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	480,390,410	455,770,765	38,431,233

注意事項：
 (i) 加「*」符號的項目在相關政策框架生效後才適用。在此之前，應在有關行內填報「不適用」。

有關風險加權數額之說明，請參閱KM1披露模版。

LR2：槓桿比率

		(a)	(b)
		美元	
		於二零一九年 六月三十日	於二零一九年 三月三十一日
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）	517,377,123	469,292,385
2	扣減：斷定一級資本時所扣減的資產數額	-	-
3	資產負債表內風險承擔總額（不包括衍生工具合約及SFT）	517,377,123	469,292,385
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	經調整後已售出信用衍生工具合約的有效名義數額	-	-
10	扣減：就已售出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	-	-
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	30,144,203	30,152,576
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	2,953,344	2,961,718
15	代理交易風險承擔	-	-
16	由SFT產生的風險承擔總額	33,097,547	33,114,294
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	25,585,568	29,086,027
18	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	(12,792,784)	(14,963,347)
19	資產負債表外項目	12,792,784	14,122,680
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	112,101,207	108,869,952
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	563,267,454	516,529,359
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	563,267,454	516,529,359
槓桿比率			
22	槓桿比率	19.90%	21.08%

本行的槓桿比率於報告期內的變動，主要由於客戶貸款和債務證券的增加而產生。

LIQ1：流動性覆蓋比率—第1類機構

由於本行並不被指定為「第1類機構」的認可機構，因此該披露模版並不適用於本行。

CR8：在IRB計算法下信用風險承擔的風險加權數額流動表

由於本行並不使用IRB計算法來計算非證券化類別風險承擔的信用風險，因此該披露模版並不適用於本行。

CCR7：在IMM(CCR)計算法下違責風險的風險承擔的風險加權數額流動表

本行並不使用IMM(CCR)計算法來計算違責風險的風險承擔的風險加權數額，因此該披露模版並不適用於本行。

MR2：在IMM計算法下市場風險承擔的風險加權數額流動表

根據《銀行業（資本）規則》第 22(1) 條，本行被豁免計算市場風險，因此該披露模版並不適用於本行。