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

監管披露

截至二零二一年十二月三十一日止季度

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)
		於二零二一年十二月三十一日	於二零二一年九月三十日	於二零二一年六月三十日	於二零二一年三月三十一日	於二零二零年十二月三十一日
	監管資本（美元）					
1	普通股權一級(CET1)	124,362,413	122,485,057	120,735,581	118,575,130	118,086,027
2	一級	124,362,413	122,485,057	120,735,581	118,575,130	118,086,027
3	總資本	125,969,253	124,117,254	122,292,501	119,878,881	119,352,077
	風險加權數額（美元）					
4	風險加權數額總額	500,977,648	530,375,973	511,184,931	449,968,038	441,244,961
	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 (%)	24.82%	23.09%	23.62%	26.35%	26.76%
6	一級比率 (%)	24.82%	23.09%	23.62%	26.35%	26.76%
7	總資本比率 (%)	25.14%	23.40%	23.92%	26.64%	27.05%
	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%	2.500%	2.500%	2.500%
9	逆周期緩衝資本要求 (%)	0.183%	0.233%	0.192%	0.271%	0.271%
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 (%)	2.683%	2.733%	2.692%	2.771%	2.771%
12	符合認可機構的最低資本規定後可用的CET1 (%)	17.14%	15.40%	15.92%	18.64%	19.05%
	《巴塞爾協定三》槓桿比率					
13	總槓桿比率風險承擔計量	519,007,526	537,713,086	515,917,467	462,305,879	448,604,886
14	槓桿比率(LR) (%)	23.96%	22.78%	23.40%	25.65%	26.32%
	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 (%)	193.24%	196.32%	224.42%	186.48%	299.63%
	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及投資債務證券承擔數額減少，本行於報告期內之風險加權數額總額亦相應減少並導致總資本比率增加。而由於本行於LMR期內到期的欠同業借款數額增加而導致相應之限定債務增加，以致流動性維持比率在報告期內出現輕微下降趨勢。

OV1：風險加權數額概覽

		(a)	(b)	(c)
		風險加權數額		最低資本規定
	美元	**於二零二一年十二月三十一日**	**於二零二一年九月三十日**	**於二零二一年十二月三十一日**
1	非證券化類別風險承擔的信用風險	478,937,777	508,855,640	38,315,022
2	其中STC計算法	-	-	-
2a	其中BSC計算法	478,937,777	508,855,640	38,315,022
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	-	-	-
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	-	-	-
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	22,039,870	21,520,334	1,763,190
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	500,977,648	530,375,973	40,078,212

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	
		於二零二一年十二月三十一日	**於二零二一年九月三十日**
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）	514,604,392	526,694,643
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）**	514,604,392	526,694,643
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**	-	-
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	8,806,267	40,036,887
18	扣減：就轉換為信貸等值數額作出的調整	(4,403,133)	(29,018,444)
19	**資產負債表外項目**	4,403,134	11,018,443
資本及風險承擔總額			
20	一級資本	124,362,413	122,485,057
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	519,007,526	537,713,086
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	519,007,526	537,713,086
槓桿比率			
22	**槓桿比率**	23.96%	22.78%

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變動而產生。

LIQ1：流動性覆蓋比率──第1類機構

由於本行並不被香港金融管理局指定為「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。