

【附表十九】

資產證券化暴險額與應計提資本—依交易類型
102年6月30日

單位：新臺幣千元

暴險類別 簿別 角色別		資產類別	傳統型				組合型		合計			
			暴險額 ^註			應計提資本(2)	暴險額 保留或買入(3)	應計提資本(4)	暴險額 ^註 (5)=(1)+(3)	應計提資本 (6)=(2)+(4)	未證券化前 之應計提資本	
			保留或買入	提供流動性 融資額度	提供信 用增強							小計(1)
非創始銀行	銀行簿	CBO	2,514,939	-	-	2,514,939	438,071	-	-	2,514,939	438,071	
		CMO	14,580,638	-	-	14,580,638	466,580	-	-	14,580,638	466,580	
		RMBS	982,256			982,256	1,079,323			982,256	1,079,323	
	交易簿		-	-	-	-	-	-	-	-		
	小計		18,077,834	-	-	18,077,834	1,983,974	-	-	18,077,834	1,983,974	
創始銀行	銀行簿		-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	交易簿		-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	小計		-	-	-	-	-	-	-	-	-	
合計		18,077,834	-	-	18,077,834	1,983,974	-	-	18,077,834	1,983,974	-	

填表說明：

1. 「資產類別」一欄，依發行證券化之資產類型(例如信用卡、房屋淨值貸款、汽車貸款)，或所投資之證券種類(例如房貸基礎證券、商業用不動產基礎證券、資產基礎證券及擔保債權憑證)等細分。

2. 銀行簿之暴險額應填入風險抵減後之暴險額。

3. 「提供流動性融資額度」一欄，應包括已動撥及未動撥之暴險額。

註：本表暴險額不含已列入資本扣除項目之金額。