

【附表二十】

資產證券化暴險額與應計提資本—依交易類型
105年6月30日

單位：新臺幣千元

| <div> <div>暴險類別</div> <div>簿別</div> <div>角色別</div> </div> | | 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 | 應計提資本(4) | 暴險額 ^註 | 應計提資本 | 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) | | 保留或買入(3) | | (5)=(1)+(3) | (6)=(2)+(4) | |
| 非創始銀行 | 銀行簿 | CBO | 2,575,842 | - | - | 2,575,842 | 499,874 | - | - | 2,575,842 | 499,874 | |
| | | CMO | 44,177,405 | - | - | 44,177,405 | 1,524,120 | - | - | 44,177,405 | 1,524,120 | |
| | | RMBS | 3,139,561 | | | 3,139,561 | 596,642 | | | 3,139,561 | 596,642 | |
| | | | | | | | | | | | | |
| | 交易簿 | | - | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| | 小計 | | 49,892,808 | - | - | 49,892,808 | 2,620,637 | - | - | 49,892,808 | 2,620,637 | |
| 創始銀行 | 銀行簿 | | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 交易簿 | | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| | 小計 | | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合計 | | | 49,892,808 | - | - | 49,892,808 | 2,620,637 | - | - | 49,892,808 | 2,620,637 | - |

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。