

Hypothekendarlehen		Q 4 2017					
Deckungsmasse (nom.)	(Mio. €)		Umlaufende Pfandbriefe (nom.)	(Mio. €)			
WAL der Deckungsmasse (Total)	Jahre	4,7	WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)	Jahre	4,3		
Anteil von "insured mortgages"	%		Sind Soft Bullet Strukturen enthalten?	Y/N/Not allowed			
Sind Versicherungen Bestandteil der Deckungsmasse?			Wenn ja: Ausmass der Fälligkeitsverschiebung?	Monate			
Sind garantierte Kredite in Deckungsmasse enthalten?	Y/N		Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt?	Y/N			
Anteil garantierter Kredite	%		Sind Pass through Strukturen enthalten?	Y/N/Not allowed			
Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien)	%						
Sind "self certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse?	Y/N		Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer	(Mio. €)	456,30		
Sind "limited certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse?	Y/N						
Anteil von " non first lien mortgages"	%			Residential	Commercial		
Sind ABS Bestandteil der Deckungsmasse?	Y/N		Anzahl der Kreditnehmer	0	75		
"interest only loans"	(Mio. €)	759,91	Anzahl der Kredite	0	56		
Notenbankfähige Wertpapiere	(Mio. €)	130,50	Anzahl der Objekte	0	83		
Aufteilung der weiteren Deckungswerte i.S. d. § 19 Abs. 1 Nr. 2 nach Bonitätsstufe			Selbstgenutzte Wohnungen in der Deckungsmasse (Mio. €)	0,00			
Bonitätsstufe 1	(Mio. €)	0,00	Mehrfamilienhäuser in der Deckungsmasse (Mio. €)				
Bonitätsstufe 2	(Mio. €)	0,00					
Sind Derivate in Deckung?	Y/N						
Typ der Swap-Kontrahenten? (Intern, Extern, Beide)	I/E/B						
Nettobarwert der Derivate in Deckung	(Mio. €)						
<b>Währungspositionen (nominal)</b>	(Mio. €)	Pfandbriefe	Deckungsmasse				
<b>EUR</b>		<b>1.128,70</b>	<b>1.453,22</b>				
Ratingagentur		Fitch	Moody 's	S&P	DBRS	Scope	
Aktuelles Pfandbriefrating			Aaa				
Deckungsmasse nach Beleihungsauslauf in Bandbreiten		0- ≤20	>20- ≤30	>30- ≤40	>40- ≤50	>50- ≤60	
	(Mio. €)	0,00	4,27	75,00	9,85	1.233,61	
Deckungsmasse nach Alter der Kredite in Bandbreiten -seasoning- residential+commercial		≤12 Monate	>12 - ≤24 Monate	>24 - ≤36 Monate	>36 - ≤60 Monate	>60 - ≤120 Monate	> 120 Monate
	(Mio. €)	84,93	434,99	547,43	255,37	0,00	0,00