

erweitertes vdp-Template

| Hypothekendarlehen | | Q 2 2020 | | | | |
|--|----------|------------------|--|---------------|------------------|----------|
| Deckungsmasse (nom.) | (Mio. €) | 1.473,3 | Umlaufende Pfandbriefe (nom.) | (Mio. €) | 1.297,5 | |
| WAL der Deckungsmasse (Total) | Jahre | 4,0 | WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total) | Jahre | 3,3 | |
| Anteil von "insured mortgages" | % | 100,0 | Sind Soft Bullet Strukturen enthalten? | Ja/Nein | Nein | |
| Sind Versicherungen Bestandteil der Deckungsmasse? | | Ja | Wenn ja: Ausmass der Fälligkeitsverschiebung? | Monate | - | |
| Sind garantierte Kredite in Deckungsmasse enthalten? | Ja/Nein | Nicht anwendbar* | Ist Fälligkeitsverschiebung gesetzlich geregelt? | Ja/Nein | Nein | |
| Anteil garantierter Kredite | % | Nicht anwendbar* | Sind Pass through Strukturen enthalten? | Ja/Nein | Nicht anwendbar* | |
| Gesetzliche Überdeckung (barwertig nach Stressszenarien) | % | 2,0 | | | | |
| Sind "self certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja/Nein | Nicht anwendbar* | Gesamtkreditbetrag der 10 größten Kreditnehmer | (Mio. €) | 363,5 | |
| Sind "limited certified loans" Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja/Nein | Nicht anwendbar* | | | | |
| Anteil von "non first lien mortgages" | % | Nicht anwendbar* | | Residential | Commercial | |
| Sind ABS Bestandteil der Deckungsmasse? | Ja/Nein | Nicht anwendbar* | Anzahl der Kreditnehmer | 9 | 114 | |
| "interest only loans" | (Mio. €) | 832,1 | Anzahl der Kredite | 5 | 59 | |
| Notenbankfähige Wertpapiere | (Mio. €) | 165,0 | Anzahl der Objekte | 98 | 126 | |
| Aufteilung der Forderungen gegenüber Zentralbanken und Kreditinstituten i.S. d. § 28 Abs. 1 Nr. 5 nach Bonitätsstufe | | | Selbstgenutzte Wohnungen in der Deckungsmasse (Mio. €) | | | |
| Bonitätsstufe 1 | (Mio. €) | - | Mehrfamilienhäuser in der Deckungsmasse (Mio. €) | | | |
| Bonitätsstufe 2 | (Mio. €) | - | | | | |
| Sind Derivate in Deckung? | Y/N | N | | | | |
| Typ der Swap-Kontrahenten? (Intern, Extern, Beide, None) | I/E/B/N | | | | | |
| Nettobarwert der Derivate in Deckung | (Mio. €) | - | | | | |
| Währungspositionen (nominal) | | (Mio. €) | Pfandbriefe | Deckungsmasse | | |
| EUR | | | 1.297,5 | 1.473,3 | | |
| AUD | | | 0,0 | 0,0 | | |
| CAD | | | 0,0 | 0,0 | | |
| CHF | | | 0,0 | 0,0 | | |
| CZK | | | 0,0 | 0,0 | | |
| DKK | | | 0,0 | 0,0 | | |
| GBP | | | 0,0 | 0,0 | | |
| HKD | | | 0,0 | 0,0 | | |
| JPY | | | 0,0 | 0,0 | | |
| NOK | | | 0,0 | 0,0 | | |
| SEK | | | 0,0 | 0,0 | | |
| USD | | | 0,0 | 0,0 | | |
| 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. €) | 0,0 | 4,3 | 75,0 | 0,0 | 1.229,1 |

erweitertes vdp-Template

| 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. €) | 96,3 | 221,9 | 195,6 | 696,3 | 98,2 | 0,0 |