

NATIXIS Pfandbriefbank AG

Veröffentlichung gem. vdp Bonitätsdifferenzierungsmodell

Stichtag Q3 2021

I) Angaben zum Hypothekendarlehenpfandbrief

(Angaben in Mio. Euro)

| | Nennwert | Barwert |
|---|------------|------------|
| Gesamtbetrag des Pfandbriefumlaufs inkl. Derivate | 1.356,00 | 1.370,39 |
| Gesamtbetrag der Deckungsmassen inkl. Derivate | 1.589,87 | 1.662,01 |
| Überdeckung in Mio. EUR gem. PfandBG | 233,87 | 291,62 |
| Überdeckung in % gem. PfandBG | 17,25% | 21,28% |
| Abschlag gem. vdp Bonitätsdifferenzierungsmodell | 0,0 | 0,0 |
| Überdeckung inkl. Abschlag in Mio. EUR | 233,87 | 291,62 |
| Überdeckung inkl. Abschlag in % | 17,25% | 21,28% |