

Hypothekendarlehen		Q1 2017					
Deckungsmasse (nom.)	(Mio. €)		Umlaufende Pfandbriefe (nom).		(Mio. €)		
WAL der Deckungsmasse (Total)	Jahre	5,0	WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)		Jahre		4,8
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. €)	338,42	
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	110	
"interest only loans"	(Mio. €)	777,45	Anzahl der Kredite		0	49	
Notenbankfähige Wertpapiere	(Mio. €)	125,00	Anzahl der Objekte		0	125	
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>1.197,70</b>	<b>1.436,93</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	0,00	95,00	9,85	1.207,09	
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. €)	308,68	643,84	230,11	129,31	0,00	0,00