

Hypothekenpfandbriefe		Q 2 2017						
Deckungsmasse (nom.)	(Mio. €)		Umlaufende Pfandbriefe (nom).				(Mio. €)	
WAL der Deckungsmasse (Total)	Jahre	5,1	WAL der ausstehenden Pfandbriefe (Total)				Jahre	4,6
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. €)	461,30		
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	66		
"interest only loans"	(Mio. €)	766,49	Anzahl der Kredite		0	49		
Notenbankfähige Wertpapiere	(Mio. €)	130,50	Anzahl der Objekte		0	71		
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>1.180,70</b>	<b>1.387,13</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	80,00	9,85	1.162,51		
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. €)	228,30	705,49	236,10	86,75	0,00	0,00	