

| Hypothekendarlehen  |          | Q3 2017    |  |                  |                  |                   |              |
|---|----------|------------|--|------------------|------------------|-------------------|--------------|
| Deckungsmasse (nom.)  | (Mio. €) |            | Umlaufende Darlehen (nom.)                             |                  | (Mio. €)         |                   |              |
| WAL der Deckungsmasse (Total)   | Jahre    | 4,9        | WAL der ausstehenden Darlehen (Total)                  |                  | Jahre            |                   | 4,5          |
| 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                | 71                |              |
| "interest only loans"   | (Mio. €) | 772,08     | Anzahl der Kredite                                     |                  | 0                | 54                |              |
| Notenbankfähige Wertpapiere   | (Mio. €) | 130,50     | Anzahl der Objekte                                     |                  | 0                | 81                |              |
| Aufteilung der weiteren Deckungswerte<br>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>1.145,70</b>  | <b>1.439,24</b>  |                  |                   |              |
|   |          |            |  |                  |                  |                   |              |
|   |          |            |  |                  |                  |                   |              |
| Ratingagentur   |          | Fitch      | Moody 's   | S&P              | DBRS             | Scope             |              |
| Aktuelles Darlehenrating  |          |            | 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             | 1.219,62          |              |
| Deckungsmasse nach Alter<br>der Kredite in Bandbreiten -seasoning- residential+commercial |          | ≤12 Monate | >12 - ≤24 Monate                                       | >24 - ≤36 Monate | >36 - ≤60 Monate | >60 - ≤120 Monate | > 120 Monate |
|   | (Mio. €) | 191,06     | 562,31   | 399,43           | 155,95           | 0,00              | 0,00         |