

Hypothekendarlehen								Q 1 2018									
Deckungsmasse (nom.) (Mio. €)				Umlaufende Darlehen (nom.) (Mio. €)													
WAL der Deckungsmasse (Total)		Jahre		4,6		WAL der ausstehenden Darlehen (Total)		Jahre		4,2							
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. €)		393,50					
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		6		81					
"interest only loans"				(Mio. €)		789,72		Anzahl der Kredite		3		60					
Notenbankfähige Wertpapiere				(Mio. €)		130,50		Anzahl der Objekte		68		88					
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. €)		Darlehen		Deckungsmasse									
<b>EUR</b>				<b>1.118,50</b>		<b>1.526,89</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		1.307,27			
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. €)		135,45		380,23		650,38		230,33		0,00		0,00	