

ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΚΑΛΥΜΜΕΝΩΝ ΑΞΙΟΓΡΑΦΩΝ - Ημερομηνία συμπλήρωσης: 5/10/2012

Καλυμμένα αξιόγραφα που εξασφαλίζονται με στεγαστικά δάνεια

Καλυμμένα αξιόγραφα που εξασφαλίζονται με εμπορικά δάνεια

Καλυμμένα αξιόγραφα που εξασφαλίζονται με ναυτιλιακά δάνεια

Καλυμμένα αξιόγραφα που εξασφαλίζονται με απαιτήσεις έναντι δημοσίου

Καλυμμένα αξιόγραφα που εξασφαλίζονται με στεγαστικά δάνεια

Αξία του καλύμματος με βάση:

(i) τη βασική κάλυψη,

(ii) την εποπτική υπερκάλυψη

(iii) τη συμβατική υπερκάλυψη

Πίνακας ληκτότητας καλυμμένων αξιογράφων με ISIN XS0651149840 και του αντίστοιχου καλύμματος

| | ≤1 έτος €' 000 | 1<έτη≤2 €' 000 | 2<έτη≤3 €' 000 | 3<έτη≤4 €' 000 | 4<έτη≤5 €' 000 | 5<έτη≤10 €' 000 | >10 έτη €' 000 | Σύνολο €' 000 |
|----------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|------------------|
| Καλυμμένα Αξιογραφα (αξία) | 0 | 550,000,000 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 550,000,000 |
| Κάλυμμα (αξία) | 461,221 | 2,302,592 | 4,945,266 | 7,997,514 | 8,365,293 | 89,486,488 | 506,101,687 | 619,660,061 |

Απαιτήσεις κάτω από συμβάσεις αντιστάθμισης κινδύνου

Ποσοστό επί της αξίας της βασικής κάλυψης

Υποχρεώσεις κάτω από συμβάσεις αντιστάθμισης κινδύνου

Ποσοστό επί των συνολικών υποχρεώσεων του καλύμματος

Συμπληρωματικά περιουσιακά στοιχεία στη βασική κάλυψη

Ποσοστό των συμπληρωματικών περιουσιακών που προσμετρούνται στη

βασική κάλυψη επί της συνολικής αξίας της βασικής κάλυψης

Πίνακας στεγαστικών δανείων, σύμφωνα με την αξία τους και τη γεωγραφική κατανομή των υποκείμενων ενυπόθηκων ακινήτων

| | Αξία≤€300.000 | | 300.000<Αξία≤€1.000.000 | | 1.000.000<Αξία≤€5.000.000 | | Αξία>€5.000.000 | |
|---|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|-------------------------|
| | Αριθμός κύριων περιουσιακών στοιχείων | Συνολική αξία σε €' 000 | Αριθμός κύριων περιουσιακών στοιχείων | Συνολική αξία σε €' 000 | Αριθμός κύριων περιουσιακών στοιχείων | Συνολική αξία σε €' 000 | Αριθμός κύριων περιουσιακών στοιχείων | Συνολική αξία σε €' 000 |
| Τοποθεσία υποκείμενων ενυπόθηκων ακινήτων | | | | | | | | |
| Ελλάδα | 11,594 | 595,452,128 | 59 | 24,207,933 | 0 | 0 | 0 | 0 |

Πίνακας στεγαστικών δανείων που παρουσιάζουν καθυστέρηση, σύμφωνα με τη γεωγραφική κατανομή των υποκείμενων ενυπόθηκων ακινήτων

| | Συνολική αξία δανείων σε καθυστέρηση | | | | | | |
|---|--------------------------------------|-------------------------|--------------|-------------------------|--------------|-------------------------|-------------|
| | ≤30 ημέρες | | 30<ημέρες≤60 | | 60<ημέρες≤90 | | Σύνολο |
| | €' 000 | Ποσοστό επί του συνόλου | €' 000 | Ποσοστό επί του συνόλου | €' 000 | Ποσοστό επί του συνόλου | |
| Τοποθεσία υποκείμενων ενυπόθηκων ακινήτων | | | | | | | |
| Ελλάδα | 79,962,271 | 12.90% | 28,942,748 | 4.67% | 7,752,443 | 1.25% | 116,657,462 |