



Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 1, Nr. 3

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	12.430,0	9.639,2	2.790,8
davon Derivate	6,6	-	
Barwert	13.700,3	10.366,4	3.333,9
davon Derivate	226,1	-	
Risikobarwert *)	13.544,2	10.393,4	3.150,8

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	14.912,7	11.822,0	3.090,7
davon Derivate	-381,4	-	
Barwert	16.464,1	12.716,4	3.747,7
davon Derivate	-	150,3	
Risikobarwert *)	16.512,0	12.836,0	3.676,0

*) dynamische Methode gem. §5 BarWertVO / statische Methode gem. §6 BarWertVO

Gesamtbetrag der Deckungsmasse/der in Umlauf befindlichen Pfandbriefe in Höhe des Nennwerts und Barwerts (Mio. €) nach vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodell

	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf	Überdeckung
Nennwert	12.430,0	9.639,2	2.790,8
Barwert	13.700,3	10.366,4	3.333,9

Werte des Vorjahres (Mio. €)

	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr	Überdeckung Vorjahr
Nennwert	14.912,7	11.822,0	3.090,7
Barwert	16.464,1	12.716,4	3.747,7

Laufzeitstruktur der in Umlauf befindlichen Hypothekendarlehen sowie Zinsbindungsfristen der entsprechenden Deckungsmassen (Mio. €)

§28 Abs. 1 Nr. 2

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse	Pfandbriefe im Umlauf
bis zu 6 Monate	1.282,0	969,4
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	584,0	1.465,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	632,2	911,5
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	854,2	1.354,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	2.511,8	1.714,0
mehr als 3 bis 4 Jahre	2.294,9	700,5
mehr als 4 bis 5 Jahre	1.861,7	398,6
mehr als 5 bis 10 Jahre	2.107,0	1.869,4
mehr als 10 Jahre	302,2	256,0
Total	12.430,0	9.639,2

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Zinsbindungsfristen / Laufzeitstruktur	Deckungsmasse Vorjahr	Pfandbriefe im Umlauf Vorjahr
bis zu 6 Monate	1.320,5	838,9
mehr als 6 Monate bis zu 12 Monaten	1.347,2	1.266,0
mehr als 12 Monate bis zu 18 Monaten	637,5	969,2
mehr als 18 Monate bis zu 2 Jahren	1.120,4	1.496,8
mehr als 2 bis 3 Jahre	1.992,4	2.320,3
mehr als 3 bis 4 Jahre	3.020,5	1.675,6
mehr als 4 bis 5 Jahre	2.088,8	705,3
mehr als 5 bis 10 Jahre	3.046,8	2.106,7
mehr als 10 Jahre	338,6	443,2
Total	14.912,7	11.822,0

Verteilung der nennwertig als Deckung in Ansatz gebrachten Beträge nach ihrer Höhe in Stufen (Mio. €)

§28 Abs. 2 Nr. 1a

Stufen	Deckungsmasse
bis 300T€	17,9
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	63,1
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	691,2
mehr als 10 Mio. €	10.782,9
Total	11.555,1

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Stufen	Deckungsmasse im Vorjahr
bis 300T€	27,9
mehr als 300T€ bis 1 Mio. €	84,3
mehr als 1 Mio. € bis 10 Mio. €	958,5
mehr als 10 Mio. €	12.710,0
Total	13.780,7

Weitere Deckungswerte gemäß §28 Abs. 1 Nr. 4, Nr. 5 und Nr. 6 - Detaildarstellung (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 1	Geldforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 2		Schuldverschreibungen nach §19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	-	-	-	564,3	564,3
EU-Institutionen	-	-	-	30,0	30,0
Frankreich	-	-	-	145,0	145,0
Österreich	-	-	-	129,0	129,0
Total	0,0	0,0	0,0	868,3	868,3

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Staaten	Ausgleichsforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 1	Geldforderungen nach §19 Abs. 1 Nr. 2		Schuldverschreibungen nach §19 Abs. 1 Nr. 3	Gesamt
		Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen i.S.d. Art. 129 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013		
Deutschland	-	-	-	844,4	844,4
EU-Institutionen	-	-	-	110,0	110,0
Frankreich	-	-	-	170,0	170,0
Österreich	-	-	-	389,0	389,0
Total	0,0	0,0	0,0	1.513,4	1.513,4

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendete Deckungswerte

Umlaufende Pfandbriefe		9.639,2	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		56,3	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		12.430,0	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt		-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse		37,7	%

§28 Abs. 1 Nr. 7

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)		5,0	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,4	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		38,4	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung						
Währung					Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
	CAD				25,8	Mio. €
CHF				16,6	Mio. €	
CZK				6,9	Mio. €	
DKK				81,5	Mio. €	
EUR				2.623,4	Mio. €	
GBP				304,5	Mio. €	
NOK				0,6	Mio. €	
SEK				8,3	Mio. €	
USD				174,5	Mio. €	

§28 Abs. 1 Nr. 10

Werte des Vorjahres gemäß §28 Abs. 5 (Mio. €)

Umlaufende Pfandbriefe		11.822,0	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe		50,5	%

§28 Abs. 1 Nr. 9

Deckungsmasse		14.912,7	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, die die Grenzen nach §13 Abs. 1 überschreiten		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 2 liegt		-	Mio. €
davon Gesamtbetrag der Forderungen, der oberhalb der %-Werte nach §19 Abs. 1 Nr. 3 liegt		-	Mio. €
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse		37,6	%

§28 Abs. 1 Nr. 7

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 8

§28 Abs. 1 Nr. 9

volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (seasoning)		4,7	Jahre
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Beleihungswertbasis		57,3	%
durchschnittlich gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis		40,1	%

§28 Abs. 1 Nr. 11

§28 Abs. 2 Nr. 3

Nettobarwert nach §6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung						
Währung					Saldo aus Aktiv-/ Passivseite	
	CAD				13,5	Mio. €
CHF				23,1	Mio. €	
CZK				-3,0	Mio. €	
DKK				68,9	Mio. €	
EUR				3.786,8	Mio. €	
GBP				-95,5	Mio. €	
NOK				1,5	Mio. €	
SEK				-20,2	Mio. €	
USD				-62,6	Mio. €	

§28 Abs. 1 Nr. 10